

運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2020年12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12月11日に第8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 (E T F) を主要投資対象とします。なお、「D I A Mマナーマザーファンド」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。 ※D R（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。
運用方法	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。
	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 (E T F) 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 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新株予約権付社債（転換社債）比率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率	純 資 産 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率							
4 期（2018年12月11日）	円 10,007	円 0	% △3.6	% 26.9	% 1.0	% 58.2	% －	% －	% 10.5	百万円 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
8 期（2020年12月11日）	11,486	0	7.1	27.8	1.6	57.3	－	－	9.9	10,467

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

（注2）株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

（注3）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注4）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注6）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新株予約権付社債（転換社債）比率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
		騰 落 率						
(期 首) 2020 年 6 月 11 日	円 10,724	% －	% 26.0	% 2.4	% 60.0	% －	% －	% 8.9
6 月 末	10,634	△0.8	25.8	2.7	59.2	－	－	8.6
7 月 末	10,979	2.4	27.2	2.3	58.1	－	－	8.8
8 月 末	11,095	3.5	26.5	4.5	55.6	－	－	9.1
9 月 末	10,944	2.1	26.4	1.9	59.6	－	－	8.9
10 月 末	10,961	2.2	26.8	1.9	57.0	－	－	8.9
11 月 末	11,439	6.7	28.7	2.2	57.7	－	－	9.9
(期 末) 2020 年 12 月 11 日	11,486	7.1	27.8	1.6	57.3	－	－	9.9

（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。

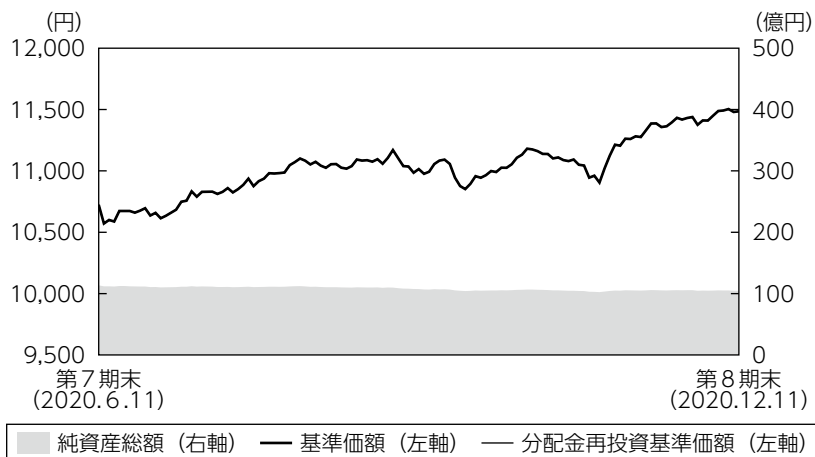
（注3）株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

（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（2020年6月12日から2020年12月11日まで）

基準価額等の推移



第8期首：10,724円
 第8期末：11,486円
 （既払分配金0円）
 騰落率：7.1%
 （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

当期は全ての資産が上昇したため、基準価額は上昇しました。特に株式市場では、期初は欧米における新型コロナウイルスの感染拡大や米中対立激化に対する懸念などから調整する場面もありましたが、経済活動正常化への期待感などから底堅く推移しました。2020年9月以降は米国大統領選挙を巡る不透明感などから調整しましたが、その後米国大統領選挙の結果判明や、11月以降ワクチン開発の進展報道を好感して反発し、前期末比で上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.8%
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	1.8%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.2%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	21.7%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2.7%

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は欧米における新型コロナウイルスの感染拡大から調整する場面もありましたが、経済活動正常化への期待感などから底堅く推移しました。2020年9月以降は利益確定の売りが広がったことや大統領選挙を巡る不透明感から調整しましたが、その後、大統領選挙の結果判明等から反発して期末を迎えました。欧州市場は方向感に欠ける展開が続きましたが、11月以降ワクチン開発の進展報道を好感して反発し、各国市場は前期末比で上昇しました。

先進国債券市場では、米国債の利回りは上昇（価格は低下）しました。一方、ドイツ債の利回りは低下（価格は上昇）しました。米国債利回りはF R B（米連邦準備理事会）の金融政策の新戦略を受けて米国金融緩和の長期化観測が強まり利回りは低下していましたが、新型コロナウイルスのワクチン開発の期待を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債については新型コロナウイルス感染再拡大に伴う欧州景気の下振れ懸念やE C B（欧州中央銀行）の追加緩和期待から利回りが低下しました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は新型コロナウイルスのワクチン開発進展や感染の再拡大を材料に期半ばにかけて一進一退の展開となりました。期末には米国大統領選挙が終了し政治の先行き不透明感が和らいだことや、米製薬大手が開発中のワクチンが治験で高い有効性を示したとの報道を受け上昇しました。豪州リート市場は上昇基調となり、欧州リート市場は期半ばにかけて下落基調となりましたが、期末には共に上昇しました。

新興国株式市場は上昇しました。米中対立激化に対する懸念などから調整する場面も見られましたが、新型コロナウイルスに対するワクチンの開発や世界的な経済活動再開への期待から堅調に推移しました。2020年9月に入ると米国で大型ハイテク株を中心に売りが広がる中、リスク選好の動きが後退したことから調整しましたが、10月以降、中国経済の底堅さやワクチン開発の進展報道などが好感され堅調に推移しました。

新興国債券市場は上昇（利回りは低下）しました。期初から2020年8月上旬にかけては、ロックダウン（都市封鎖）後の経済活動再開に伴う景気回復期待などから上昇しました。9月には米国の追加経済対策協議の難航や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて軟調となりましたが、11月以降は米国大統領選挙でのバイデン氏勝利による不透明感の後退やワクチンへの期待感などから、再度上昇しました。米国長期金利は上昇し、対米国債スプレッド（利回り格差）は縮小しました。

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E T F（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。

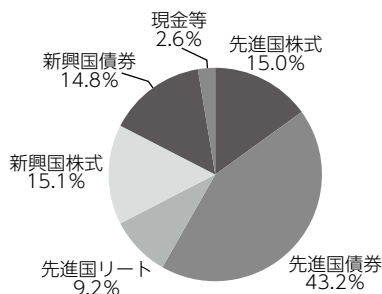
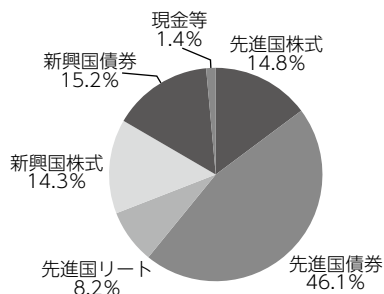
先進国株式：15%、先進国債券：45%、先進国リート：10%、新興国株式：15%、新興国債券：15%

【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、「D I A M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（E T F）、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M S C I コクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●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F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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 R E I Tインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）と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M S C I エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●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
	2020年6月12日 ～2020年12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	1,486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8期		項目の概要
	(2020年6月12日 ～2020年12月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	69円	0.623%	(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11,036円です。
(投信会社)	(33)	(0.303)	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)	(33)	(0.303)	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	1	0.008	(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)	(1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	1	0.011	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.008)	
(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)	(0.003)	
(d) その他費用	3	0.026	(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)	(2)	(0.019)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.004)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	74	0.668	

(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。

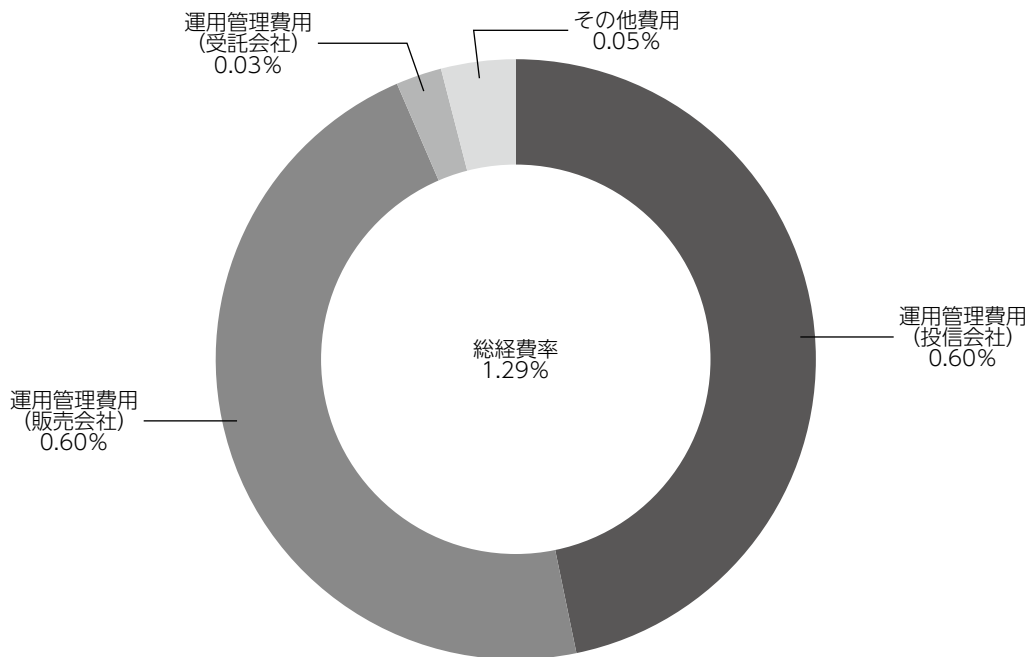
(注3) 比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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1.29%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（2020年6月12日から2020年12月11日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	－	－	77,615	323,200
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	－	－	538,492	793,600
外国リート・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	－	－	293,248	362,200
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	－	－	102,696	213,000

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	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	74,903,136千円	44,467,519千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	352,130,531千円	41,322,440千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.21	1.07

(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（2020年6月12日から2020年12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		
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ・ドル)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF		13.3	13.3	362	37,723
合 計	□ 数 ・ 金 額	13.3	13.3	362	37,723
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<0.3%>	1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) < >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	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	439,823	362,207	1,572,417
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	3,589,216	3,050,723	4,523,612
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	812,123	812,123	961,310
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,464,721	1,171,472	1,547,515
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	843,793	741,096	1,551,337

■投資信託財産の構成

2020年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 37,723	% 0.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,572,417	14.9
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	4,523,612	42.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	961,310	9.1
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,547,515	14.6
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,551,337	14.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	379,734	3.6
投 資 信 託 財 産 総 額	10,573,650	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12月11日現在、40,434千円、0.4％、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは412,407,730千円、99.8％、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523,661,396千円、99.5％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは52,193,399千円、97.5％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは71,190,290千円、99.8％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは142,746,884千円、99.5％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年12月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝104.01円、1カナダ・ドル＝81.58円、1オーストラリア・ドル＝78.30円、1香港・ドル＝13.42円、1シンガポール・ドル＝77.95円、1ニュージーランド・ドル＝73.73円、1台湾・ドル＝3.68円、1イギリス・ポンド＝138.28円、1イスラエル・シェケル＝31.95円、1スイス・フラン＝117.41円、1トルコ・リラ＝13.18円、1デンマーク・クローネ＝16.97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＝12.32円、1メキシコ・ペソ＝5.20円、1フィリピン・ペソ＝2.16円、100チリ・ペソ＝14.14円、100コロンビア・ペソ＝3.04円、1クウェート・ディナール＝341.24円、1カタール・リアル＝28.35円、1サウジアラビア・リアル＝27.78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＝0.73円、1アラブ首長国連邦・ディルハム＝28.36円、1ブラジル・レアル＝20.72円、1チェコ・コルナ＝4.80円、100韓国・ウォン＝9.59円、1オフショア・人民元＝15.93円、1マレーシア・リンギット＝25.66円、1南アフリカ・ランド＝6.93円、1タイ・バーツ＝3.46円、1ポーランド・ズロチ＝28.53円、100ハンガリー・フォリント＝35.69円、1ユーロ＝126.29円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年12月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,200,966,236円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	368,600,208
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	37,723,491
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,572,417,221
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)	4,523,612,882
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	961,310,068
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,547,515,206
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	1,551,337,167
未 収 入 金	5,638,449,993
(B) 負 債	5,733,405,195
未 払 金	5,637,571,452
未 払 解 約 金	28,310,671
未 払 信 託 報 酬	67,309,269
そ の 他 未 払 費 用	213,803
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,467,561,041
元 本	9,113,224,888
次 期 繰 越 損 益 金	1,354,336,153
(D) 受 益 権 総 口 数	9,113,224,888口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,486円

(注) 期首における元本額は10,577,163,269円、当期中における追加設定元本額は122,826,944円、同解約元本額は1,586,765,325円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月12日 至2020年12月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	76,892円
受 取 配 当 金	127,280
受 取 利 息	312
支 払 利 息	△50,700
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	758,567,257
売 買 益	925,932,257
売 買 損	△167,365,000
(C) 信 託 報 酬 等	△67,840,767
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	690,803,382
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	332,817,160
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	330,715,611
(配 当 等 相 当 額)	(253,166,454)
(売 買 損 益 相 当 額)	(77,549,157)
(G) 合 計(D+E+F)	1,354,336,153
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,354,336,153
追 加 信 託 差 損 益 金	330,715,611
(配 当 等 相 当 額)	(253,273,446)
(売 買 損 益 相 当 額)	(77,442,165)
分 配 準 備 積 立 金	1,023,620,542

(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	104,326,838円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	368,760,635
(c) 収 益 調 整 金	330,715,611
(d) 分 配 準 備 積 立 金	550,533,069
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,354,336,153
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,486.12
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

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		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率	(円換算ベース、配当 込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	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）。

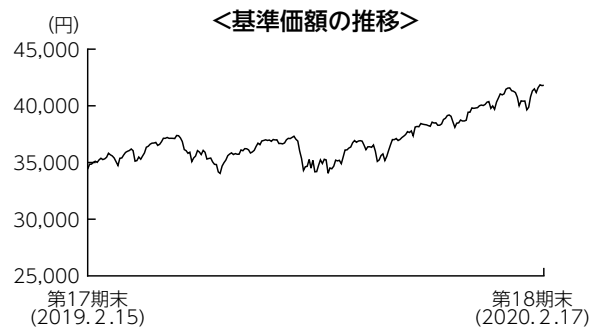
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2019 年 2 月 15 日	円 34,418	% －	ポイント 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）

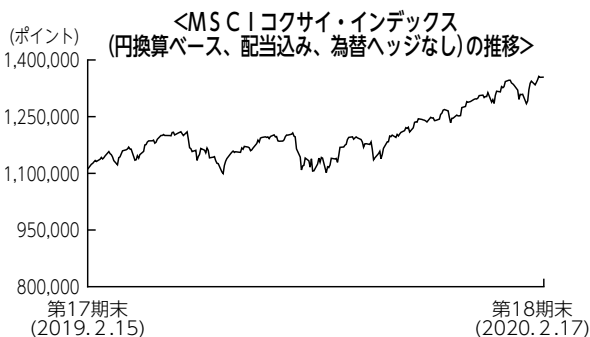


基準価額の推移

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コロナウイルス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	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		売		付				
		株	数	金	額	株	数	金	額			
外	ア	メ	リ	カ	百株 20,597.12 (944.38)	千アメリカ・ドル 148,036 (△3,748)	百株	千アメリカ・ドル 408,490	52,364.81			
	カ		ナ	ダ	百株 3,511.18 (△1,155.8)	千カナダ・ドル 13,919 (△390)	百株	千カナダ・ドル 30,759	8,023.97			
	オ	ー	ス	ト	ラ	リア	百株	千オーストラリア・ドル 21,352	12,399.51			
	香				港	百株 8,847 (969.27)	千香港・ドル 25,910 (－)	百株	千香港・ドル 64,320	18,974.5		
	シ	ン	ガ	ポ	ー	ル	百株 1,711 (－)	千シンガポール・ドル 1,203 (－)	百株	千シンガポール・ドル 3,530	11,375.4	
	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	千ニュージーランド・ドル 698	912.87
	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	千イギリス・ポンド 27,695	218,837.93		
	イ	ス	ラ	エ	ル	百株 1,257.5 (－)	千イスラエル・シケル 2,010 (－)	百株	千イスラエル・シケル 2,750	2,354.7		
	ス		イ	ス	百株 850.1 (375.47)	千スイス・フラン 6,472 (△480)	百株	千スイス・フラン 19,579	2,677.98			
	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	千デンマーク・クローネ 27,146	709.27		
	ノ	ル	ウ	エ	ー	百株 291.8 (74.45)	千ノルウェー・クローネ 5,929 (－)	百株	千ノルウェー・クローネ 15,917	1,353.09		
	ス	ウ	エ	ー	デ	ン	百株 559.9 (243.67)	千スウェーデン・クローナ 8,994 (－)	百株	千スウェーデン・クローナ 42,541	2,928.51	
国	ユ ー ロ 圏	ア	イ	ル	ラ	ンド	百株 341.42 (－)	千ユーロ 146 (－)	百株	千ユーロ 854	832.18	
		オ		ラ	ン	ダ	百株 1,455.84 (－)	千ユーロ 6,992 (－)	百株	千ユーロ 8,296	1,907.64	
		ベ		ル	ギ	ー	百株 162.34 (－)	千ユーロ 1,541 (－)	百株	千ユーロ 2,387	361.48	
		ル	ク	セ	ン	ブル	グ	百株 131.92 (－)	千ユーロ 234 (－)	百株	千ユーロ 573	334.29
		フ		ラ	ン	ス	百株 1,262.54 (71.83)	千ユーロ 7,234 (△12)	百株	千ユーロ 19,883	4,011.97	
		ド		イ		ツ	百株 1,335.84 (54)	千ユーロ 6,531 (△409)	百株	千ユーロ 17,458	3,740.17	
		ポ		ル	ト	ガル	百株 － (－)	千ユーロ － (－)	百株	千ユーロ 314	526.32	

				買 付		売 付	
				株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユ ー ロ ム	ス ペ イ ン	百株 1,815.36 (13,153.66)	千ユーロ 2,268 (△1)	百株 20,677.83	千ユーロ 5,748	
		イ タ リ ア	百株 4,152.7 (-)	千ユーロ 2,024 (-)	百株 11,344.16	千ユーロ 3,994	
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 499.72 (252.94)	千ユーロ 739 (-)	百株 1,374.73	千ユーロ 1,699	
		オ ー ス ト リ ア	百株 8.13 (-)	千ユーロ 38 (△35)	百株 68.57	千ユーロ 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	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	(-)	(-)	0.998 (-)	152 (-)
BOSTON PROPERTIES INC	(-)	(-)	1.282 (-)	165 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17.771 (-)	747 (-)	- (-)	- (-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	(-)	(-)	17.307 (-)	158 (-)
PROLOGIS INC	(-)	(-)	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	(-)	(-)	- (-)	- (-)
THE MACERICH COMPANY	(△11.649)	(-)	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	
	□	数	金	額	□	数	金	額
アメリカ		千□		千アメリカ・ドル		千□		千アメリカ・ドル
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□		千カナダ・ドル		千□		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□		千オーストラリア・ドル		千□		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
		(-)		(-)		(-)		(-)
LENLEASE GROUP		-		-		17.897		223
		(△42.974)		(△572)		(-)		(-)
DEXUS		20.313		265		16.334		212
		(-)		(-)		(-)		(-)
GOODMAN GROUP		-		-		15.521		230
		(-)		(-)		(-)		(-)
SCENTRE GROUP		-		-		56.688		217
		(-)		(-)		(-)		(-)
香港		千□		千香港・ドル		千□		千香港・ドル
LINK REIT		-		-		27.6		2,435
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV'T	—	—	—	—
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	(—)	(△5)	(—)	(—)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	(—)	(△1)	(—)	(—)
	192.3	461	—	—
	(—)	(△0.05769)	(—)	(—)
	—	—	32.128	7
	(32.128)	(—)	(—)	(—)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	20.951	127	23.003	122
HAMMERSON PLC	(—)	(—)	(—)	(—)
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	58.616	162
SEGRO PLC	(—)	(—)	(—)	(—)
	15.752	142	18.971	175
	(—)	(—)	(—)	(—)
	22.038	146	17.705	123
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	—	—	1.163	153
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	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	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	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	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 SOFTWARE	101.53	87.66		994	109,177	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	21.42	19.29		1,472	161,648	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,426.27	1,814.88		12,047	1,322,779	医薬品
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	52.15	—		—	—	資本市場
INGREDION INC	53.05	53.05		516	56,699	食品
ONEOK INC	374.02	324.27		2,496	274,086	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	59	59		665	73,080	保険
UNITED RENTALS INC	76.93	61.81		969	106,456	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	230.49	215.99		3,476	381,727	総合公益事業
FEDEX CORP	215.25	193.68		3,072	337,322	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	96.48	80.48		1,686	185,190	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	252.01	227.63		2,368	260,110	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	235.58	243.81		1,740	191,140	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,532.41	1,252.54		903	99,158	メディア
CSX CORP	710.27	595.4		4,738	520,318	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	382.55	314.16		464	51,052	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	140.5		683	75,036	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	243.37	200.52		1,082	118,870	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	145.53	128.2		2,613	286,918	飲料
CARDINAL HEALTH INC	269.19	229.5		1,368	150,237	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	354.48	319.62		1,361	149,501	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	521.82	432.58		5,969	655,415	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	112.32	98.65		1,155	126,840	ソフトウェア
CELGENE CORP	608.71	—		—	—	バイオテクノロジー
CITRIX SYSTEMS INC	125.26	94.64		1,154	126,807	ソフトウェア
CENTURYLINK INC	804.24	804.24		1,117	122,744	各種電気通信サービス
CERNER CORP	264.14	251.43		1,937	212,767	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,927.32	2,476.52		34,042	3,737,838	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	222.43	198.96		1,520	166,967	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	142.86	112.22		1,292	141,958	保険
CINTAS CORP	79.44	66.04		1,987	218,173	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	4,106.72	3,309.4		15,544	1,706,758	通信機器
CLOROX COMPANY	108.85	98.76		1,627	178,739	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,520.46	3,147.58		18,869	2,071,897	飲料
COPART INC	189.44	167.49		1,729	189,880	商業サービス・用品
COGNEX CORP	152.91	122.84		660	72,510	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	710	627.79		4,814	528,634	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	263.13	221.45		3,208	352,327	ホテル・レストラン・レジャー
COMERICA INC	149.31	119.85		752	82,589	銀行
NRG ENERGY, INC.	256.31	210.39		842	92,541	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
COMCAST CORP-CL A	3,943.84	3,511.08		16,182	1,776,845	メディア
CONAGRA BRANDS INC	405.73	358.02		1,170	128,506	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	267.33	252.2		2,378	261,131	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	236.16	229.37		1,571	172,541	総合公益事業
COOPER COS INC	44.84	39.36		1,390	152,690	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	162	132.2		730	80,198	飲料
CORNING INC	686.91	583.76		1,668	183,252	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	138.7		482	52,952	容器・包装
HEICO CORP-CL A	—	52.92		545	59,942	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	131.93	119.63		1,995	219,071	機械
DR HORTON INC	321.52	283.55		1,752	192,437	家庭用耐久財
DANAHER CORP	552.86	482.99		8,015	880,071	ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOODY'S CORP	154.93	129.22	3,590	394,195	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	503.31	423.7	2,898	318,305	情報技術サービス
TARGET CORP	436.5	394.21	4,597	504,824	複合小売り
DEERE & CO	262.37	238.24	4,004	439,650	機械
MORGAN STANLEY	1,132.17	951.98	5,315	583,681	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	198.91	180.81	1,815	199,383	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	29.94	27.85	2,036	223,647	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,280.37	1,394.4	19,457	2,136,428	娯楽
DOLLAR TREE INC	200.78	186.97	1,658	182,053	複合小売り
DOVER CORP	126.35	111.13	1,332	146,254	機械
OMNICOM GROUP	193.25	173.65	1,356	148,987	メディア
DTE ENERGY CO	160.34	148.17	1,985	218,038	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	611.77	568.01	5,752	631,658	電力
FLOWSERVE CORP	131.39	98.82	458	50,356	機械
DARDEN RESTAURANTS INC	109.9	97	1,180	129,628	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	832.27	637.71	2,432	267,058	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	8,277.12	6,844.79	23,854	2,619,179	銀行
CITIGROUP INC	2,166.9	1,746.72	13,762	1,511,112	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	130.09	94.23	704	77,319	化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	216.24	171.04	755	82,989	資本市場
EATON CORP PLC	384.09	318.18	3,294	361,763	電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	91.84	451	49,563	資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	249.22	226.28	1,782	195,683	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	217.62	177.49	709	77,895	メディア
ECOLAB INC	221.92	204.79	4,245	466,156	化学
PERKINELMER INC	—	83.38	796	87,486	ライフサイエンス・ツール／サービス
ELECTRONIC ARTS INC	272.14	224.91	2,467	270,880	娯楽
SALESFORCE.COM INC	624.35	644.04	12,233	1,343,242	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	—	22.43	366	40,281	保険
EMERSON ELECTRIC CO	543.24	467.05	3,433	376,974	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	102.2	86.5	1,041	114,399	ガス
ENTERGY CORP	162.59	150.31	2,016	221,368	電力
EOG RESOURCES INC	507.26	446.03	3,341	366,913	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	102.31	91.61	1,492	163,917	専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	194.24	173.46	3,729	409,506	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	147.92	125.15	918	100,848	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,696.52	3,276.09	19,869	2,181,669	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	126.34	102.09	1,076	118,226	化学
NEXTERA ENERGY INC	412.34	374.04	10,417	1,143,870	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	28.75	861	94,557	資本市場
ASSURANT INC	40.89	45.94	654	71,890	保険
FASTENAL CO	254.18	458.91	1,758	193,088	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	600.5	581.44	1,721	188,972	銀行
M&T BANK CORP	124.94	99.99	1,697	186,399	銀行
FISERV INC	357.37	443.49	5,424	595,639	情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	116.23	668	73,394	電子装置・機器・部品
MACY'S INC	247.41	—	—	—	複合小売り
FORD MOTOR CO	3,243.91	3,108.36	2,517	276,451	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	285.48	237.13	577	63,425	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,172.69	1,149.93	1,407	154,545	金属・鉱業
FLEX LTD	676.69	351.27	477	52,377	電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	164.78	142.7	1,557	171,036	保険
GAP INC/THE	182.95	182.95	331	36,439	専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	174.77	183.86	1,063	116,786	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	221.43	188.21	3,539	388,634	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	527.09	461.41	2,459	270,083	食品
GENUINE PARTS CO	134.32	116.05	1,119	122,924	販売

銘柄	期 首(前期末)	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千	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	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	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
KOHL'S 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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
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	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額	金額	
外貨建金額 邦貨換算金額						
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
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	
RENAISSANCE 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	コンピュータリット
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
SYNOPSIS 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	株数	当期株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
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	コンゴロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171	545	59,876	コンゴロマリット
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	金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
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	株数	当期株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
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	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株		千アメリカ・ドル	千円	
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
FNFG 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)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	評 価 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
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 銘 柄 数<比 率>	263,700.87 593銘柄	232,877.56 608銘柄	2,232,683 —	245,148,645 <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	—	—	—	エグジティブ不動産投資信託 (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	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(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	36,595.21	30,926.62	157,018	13,010,568	
株 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	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価	額	
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
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 : 65,230.79	株 数 : 57,763.33	110,579	8,153,048	
	銘 柄 数 < 比 率 >	銘 柄 数 < 比 率 >	—	< 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	コンピュータリット
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
WHELOCK & 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	コンピュータリット
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 : 81,955.35	株 数 : 72,797.12	275,363	3,890,888	
	銘 柄 数 < 比 率 >	銘 柄 数 < 比 率 >	—	< 1.1 % >	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(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
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,888	1,888	187	14,825	機械
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	
(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 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	
(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
ASHTAD 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	株数	当 株数	期 末 評 価 額		業 種 等
			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	
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 銘柄 数<比率>	260,125.86	232,616.39	138,461	19,827,669
		92銘柄	93銘柄	—	<5.4%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
BANK HAPOLIM 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 銘柄 数<比率>	4,668.15	3,570.95	12,746	407,884
		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 FINANCIERIE 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)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(スイス)	百株	百株	千円	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
DUFREY 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 銘柄 数<比 率>	株 数 金 額 銘柄 数<比 率>	108,947	12,181,428	
(デンマーク)	百株	百株	千円	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 銘柄 数<比 率>	株 数 金 額 銘柄 数<比 率>	152,972	2,435,317	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	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 銘柄 数<比 率>	株 数 金 額 銘柄 数<比 率>	63,008	747,914	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	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)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	評 価 額 邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	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
MILICOM 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 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	308,689	3,491,276	
(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 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	6,034	717,896	
(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	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(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 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	51,646	6,143,817	
(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 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	10,266	1,221,337	
(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 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,476	294,652	
(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	
IMERYSA	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	株 数 金 額	株 数 金 額	株 数 金 額	
	23,307.02	20,629.42	107,584	12,798,244	
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)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
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	コンプロマリット
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	株数	当 期 首(前期末)	株数	期 末		業 種 等
				評 価	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	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	59,109	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	158.02	127.08	496	59,109	496	化学
UNIPER SE	138.97	142.52	420	50,048	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	76,193	インターネット販売・通信販売
小 計	株数・金 銘柄数<比率>	20,772.55 61銘柄	18,422.22 57銘柄	90,303 —	10,742,544 <2.9%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	195.17	195.17	329	39,156	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	113,032	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	522.32	400.88	560	66,621	66,621	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株数・金 銘柄数<比率>	3,138.43 3銘柄	2,612.11 3銘柄	1,839 —	218,809 <0.1%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	5,323.01	4,772.67	5,180	616,300	616,300	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	144.26	158.85	247	29,393	29,393	電気設備
REPSOL SA	1,267.23	1,149.98	1,454	173,054	173,054	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	4,153.79	3,677.55	2,297	273,294	273,294	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	293.14	234.17	587	69,920	69,920	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	232.16	201.37	629	74,883	74,883	建設・土木
BANKINTER S.A.	579.6	579.6	363	43,189	43,189	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,956.67	5,235.94	2,745	326,569	326,569	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	290.1	236.12	564	67,188	67,188	ガス
BANCO SANTANDER SA	14,112.32	12,640.63	4,958	589,913	589,913	銀行
RED ELECTICA DE CORPORACION SA	345.96	345.96	658	78,277	78,277	電力
BANCO SABADELL	5,633.71	4,136.31	352	41,923	41,923	銀行
INDITEX	967.34	838.83	2,636	313,631	313,631	専門小売り
MAPFRE SA	844.74	844.74	204	24,308	24,308	保険
ENAGAS	180.95	180.95	463	55,170	55,170	ガス
GRIFOLS SA	235.18	235.18	776	92,352	92,352	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	468.31	386.66	1,154	137,393	137,393	建設・土木
CAIXABANK	2,972.24	2,972.24	834	99,249	99,249	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	384.92	338.91	2,468	293,667	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	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	106,903	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	—	197.8	937	111,557	111,557	各種電気通信サービス
小 計	株数・金 銘柄数<比率>	46,133.4 23銘柄	40,424.59 22銘柄	30,584 —	3,638,321 <1.0%>	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,040.14	870.3	1,629	193,809	193,809	保険
INTESA SANPAOLO	13,499.21	11,576.31	2,902	345,243	345,243	銀行
UNICREDIT SPA	1,701.44	1,557.18	2,162	257,227	257,227	銀行
ENI SPA	2,222.05	1,978.38	2,550	303,410	303,410	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	620.22	416.39	399	47,582	47,582	銀行
ENEL SPA	6,744.93	6,323.33	5,233	622,615	622,615	電力
LEONARDO SPA	262.69	283.16	324	38,653	38,653	航空宇宙・防衛
SNAM SPA	1,997.02	1,691.63	844	100,517	100,517	ガス
TELECOM ITALIA SPA	11,584.73	7,626.75	394	46,906	46,906	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	4,975.96	254	30,248	30,248	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	436.88	373.65	853	101,477	101,477	運送インフラ
TERNA SPA	1,126.86	1,136.54	738	87,800	87,800	電力
RECORDATI SPA	68.59	68.59	276	32,923	32,923	医薬品
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	557.25	397.52	356	42,370	42,370	飲料
PRYSMIAN SPA	294.18	214.52	509	60,659	60,659	電気設備
MONCLER SPA	143.53	143.53	546	65,053	65,053	繊維・アパレル・贅沢品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期		末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価	額	額	率	
(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 銘 柄 数<比 率>	48,016.69 18銘柄	40,825.23 19銘柄	21,061 —	2,505,470 <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 銘 柄 数<比 率>	7,796.14 12銘柄	7,174.07 12銘柄	10,412 —	1,238,634 <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 銘 柄 数<比 率>	704.93 6銘柄	644.49 6銘柄	2,210 —	262,942 <0.1%>		
合 計	株 数・金 額 銘 柄 数<比 率>	975,274.54 1,245銘柄	858,545.81 1,254銘柄	—	350,796,430 <94.7%>		

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

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

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

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		末
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
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)		期 末			
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	率
(アメリカ)	千□	千□	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	□ 数 銘 柄 数<比 率>	□ 数 銘 柄 数<比 率>	75,873	8,330,894		—
	39銘柄<2.1%>	41銘柄<2.2%>	—	—		2.2
(カナダ)	千□	千□	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	□ 数 銘 柄 数<比 率>	□ 数 銘 柄 数<比 率>	1,545	128,051		—
	3銘柄<0.0%>	5銘柄<0.0%>	—	—		0.0
(オーストラリア)	千□	千□	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	□ 数 銘 柄 数<比 率>	□ 数 銘 柄 数<比 率>	8,590	633,377		—
	8銘柄<0.2%>	7銘柄<0.2%>	—	—		0.2
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	185.5	157.9	12,426	175,589		0.0
小 計	□ 数 銘 柄 数<比 率>	□ 数 銘 柄 数<比 率>	12,426	175,589		—
	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	—	—		0.0
(シンガポール)	千□	千□	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)		期 末	
		口 数	口 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST		—	192.3	449	35,512
小 計	口 数	798,206	990,506	2,389	188,540
銘 柄	金 額	4銘柄<0.0%>	5銘柄<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
HAMMERSON PLC		58.616	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		59.062	55.843	556	79,631
SEGRO PLC		82.914	87.247	815	116,816
小 計	口 数	272,463	212,909	1,782	255,216
銘 柄	金 額	4銘柄<0.1%>	3銘柄<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
小 計	口 数	12.061	10.898	1,383	164,581
銘 柄	金 額	1銘柄<0.1%>	1銘柄<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
ICADE		2.234	2.234	234	27,877
KLEPIERRE		17.042	17.042	532	63,313
COVIVIO		4.675	4.265	472	56,266
小 計	口 数	27,621	27,211	1,905	226,697
銘 柄	金 額	4銘柄<0.1%>	4銘柄<0.1%>	—	—
合 計	口 数	4,078,857	4,118,923	—	10,102,948
銘 柄	金 額	64銘柄<2.6%>	67銘柄<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	期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T		百万円 7,276	百万円 —
	S & P / T S E 6 0 I X F U T		370	—
	S P I 2 0 0 F U T U R E S		221	—
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E		569	—
	D J E U R O S T O X X 5 0		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	期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 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・シェケル=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	ン	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
未	入 収 証 券(評価額)	9,281,030,671
差	入 収 配 入 当 金	981,917,778
未	入 収 委 託 証 拠 金	425,800,789
(B) 負	金	2,480,411,891
未	払 解 約 金	916,378,668
未	払 解 約 金	704,679,668
(C) 純	資 産 総 額(A-B)	211,699,000
元	次 期 繰 越 損 益 本	370,420,447,198
(D) 受	万 益 当 た り 基 準 価 額(C-D)	88,590,932,378
1	口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	281,829,514,820
		88,590,932,378円
		41,812円

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

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,405,331,645円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,265,172円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,568,890円
M I T O 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
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	42,514,197,886円
O n e D C 先進国株式インデックスファンド	189,412,832円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	176,623,075円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	878,800,098円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,066,933,587円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	117,048,457円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	341,782,574円
D I A M D C 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 エポリーション	186,919,230円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	206,435,395円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	158,994,799円
D I A M D C 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
D I A M 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
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	553,382円
D I A M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 (D C)	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・マイルクラス<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
M S I C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
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	85,286,421円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	2,001,550,769円
D I A M先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	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
D I A Mワールドバランス25V A (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
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A2 (適格機関投資家限定)	59,958,854円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	135,238,394円
D I A M国際分散バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	8,631,553円
D I A M国際分散バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	48,605,100円
D I A M国内重視バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	4,643,533円
D I A M国内重視バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	4,877,279円
D I A M世界バランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	17,536,268円
D I A M世界バランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	54,685,027円
D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	375,124,662円
D I A Mバランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	492,768,252円
D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	1,604,220,114円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	579,217,915円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A2 (適格機関投資家限定)	95,885,349円
D I A Mアグロ グローバル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	618,117,607円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	27,550,457円
D I A M世界バランスファンド55V A (適格機関投資家限定)	6,905,718円
D I A M世界バランスファンド35V A (適格機関投資家限定)	9,443,862円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A (適格機関投資家限定)	214,153,029円
D I A M世界アセットバランスファンド40V A (適格機関投資家限定)	24,495,642円
D I A M世界アセットバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	88,530,403円
D I A M世界アセットバランスファンド3V A (適格機関投資家限定)	152,767,521円
D I A M世界アセットバランスファンド4V A (適格機関投資家限定)	444,738,720円
D I A Mバランス20V A (適格機関投資家限定)	22,591,432円
D I A Mバランス40V A (適格機関投資家限定)	206,560円
D I A Mバランス60V A (適格機関投資家限定)	242,311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			利	息	12,104,811				
そ	の	他	収	益	38,840,064				
支	払		利	息	△501,575				
(B) 有	価	証	券	売	益	59,213,874,771			
売			買	買	損	74,270,892,711			
売			買	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13期（決算日 2020年6月22日）

（計算期間 2019年6月25日～2020年6月22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13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	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、「F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」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		F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比	債券先物 比	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率	(除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
9 期 (2016年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
10期 (2017年6月22日)	13,626	5.4	391.61	5.5	92.9	－	164,686
11期 (2018年6月22日)	13,477	△1.1	387.96	△0.9	97.9	－	177,029
12期 (2019年6月24日)	13,246	△1.7	381.67	△1.6	98.0	－	290,732
13期 (2020年6月22日)	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	－	454,858
	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	－	337,333

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークはF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

(注3) F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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

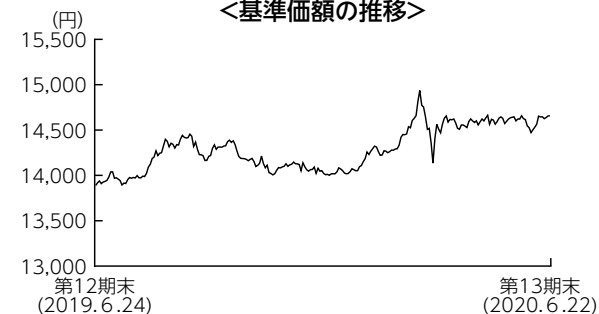
年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率	(除 く 日 本 、 円 ベ ー ス 、 為 替 ヘ ッ ジ あ り) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2019 年 6 月 24 日	円 13,888	% －	ポイント 400.89	% －	% 96.9	% －
6 月 末	13,926	0.3	401.98	0.3	97.6	－
7 月 末	13,987	0.7	403.79	0.7	96.8	－
8 月 末	14,420	3.8	416.34	3.9	95.2	－
9 月 末	14,313	3.1	413.28	3.1	97.4	－
10 月 末	14,134	1.8	408.17	1.8	99.3	－
11 月 末	14,127	1.7	407.93	1.8	96.1	－
12 月 末	14,039	1.1	405.42	1.1	98.8	－
2020 年 1 月 末	14,294	2.9	412.91	3.0	96.8	－
2 月 末	14,456	4.1	417.52	4.1	107.6	－
3 月 末	14,655	5.5	423.40	5.6	97.3	－
4 月 末	14,634	5.4	423.84	5.7	95.0	－
5 月 末	14,621	5.3	423.57	5.7	98.0	－
(期 末) 2020 年 6 月 22 日	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	－

(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6月25日から2020年6月22日まで）

＜基準価額の推移＞



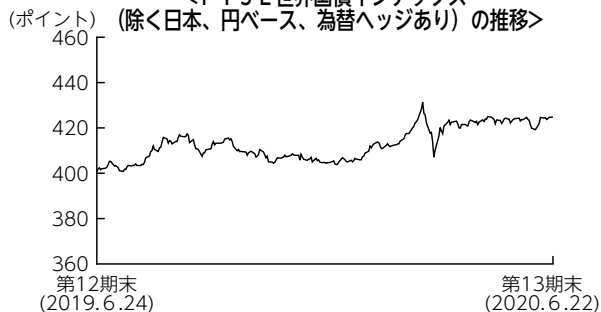
基準価額の推移

当期末の基準価額は14,658円となり、前期末比で5.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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により、F R B（米連邦準備理事会）による緊急利下げや、原油価格の大幅下落等のリスク回避姿勢が高まり、米国債やドイツ国債の利回りが低下（価格は上昇）したことが基準価額の上昇要因となりました。

＜F T S E世界国債インデックス （除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）の推移＞



投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは低下する展開となりました。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により、各中央銀行による大幅な金融緩和政策への期待感やリスク回避姿勢の高まりから債券が買われる展開となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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6.0%上昇しました。当ファンドはベンチマークを0.4%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	0.010%
(保 管 費 用)	(1)	(0.010)
(そ の 他)	(0)	(0.000)
合 計	1	0.010

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(14,296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6月25日から2020年6月22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 1,961,406	千アメリカ・ドル 2,651,381 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 103,417	千カナダ・ドル 129,463 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 156,999	千オーストラリア・ドル 176,305 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 17,234	千シンガポール・ドル 18,993 (-)
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 196,982	千イギリス・ポンド 249,658 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 32,434	千イスラエル・シェケル - (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 157,233	千デンマーク・クローネ 156,019 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 60,553	千ノルウェー・クローネ 61,084 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 61,184	千スウェーデン・クローナ 94,435 (-)
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 557,818	千メキシコ・ペソ 632,491 (-)
	マレーシア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 16,678	千マレーシア・リンギット - (-)

			買 付 額	売 付 額
外 国	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド 298,935	千南アフリカ・ランド 508,754 (-)
			千ポーランド・ズロチ 70,663	千ポーランド・ズロチ 93,130 (-)
	ユ ー ロ ー 圏	ア イ ル ラ ン ド	千ユーロ 55,148	千ユーロ 67,143 (-)
		オ ラ ン ダ	53,327	77,853 (-)
		ベ ル ギ ー	99,674	121,080 (-)
		フ ラ ン ス	362,239	426,114 (-)
		ド イ ツ	219,448	236,364 (-)
		ス ペ イ ン	181,640	218,437 (-)
		イ タ リ ア	312,325	352,628 (-)
		フ ィ ン ラ ン ド	44,313	58,887 (-)
		オ ー ス ト リ ア	72,996	86,368 (-)

(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6月25日から2020年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 1,299,750	千アメリカ・ドル 1,450,949	千円 154,917,910	% 45.9	% －	% 20.4	% 17.6	% 7.9
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 73,980	千カナダ・ドル 84,974	千円 6,659,420	2.0	－	0.9	0.7	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 87,340	千オーストラリア・ドル 101,044	千円 7,362,104	2.2	－	1.5	0.7	－
シンガポール	千シンガポール・ドル 17,430	千シンガポール・ドル 19,719	千円 1,506,137	0.4	－	0.2	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 121,440	千イギリス・ポンド 168,926	千円 22,261,093	6.6	－	5.2	1.4	－
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シェケル 26,270	千イスラエル・シェケル 32,633	千円 1,008,704	0.3	－	0.2	0.1	－
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 86,680	千デンマーク・クローネ 109,914	千円 1,759,723	0.5	－	0.4	0.1	－
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 58,420	千ノルウェー・クローネ 63,153	千円 697,851	0.2	－	0.1	0.1	－
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 63,830	千スウェーデン・クローナ 72,925	千円 822,600	0.2	－	0.1	0.1	0.0
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 499,011	千メキシコ・ペソ 554,711	千円 2,618,237	0.8	－	0.4	0.3	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 57,530	千マレーシア・リンギット 62,250	千円 1,553,765	0.5	－	0.3	0.1	－
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 70,050	千ポーランド・ズロチ 76,665	千円 2,048,493	0.6	－	0.3	0.3	0.0
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	19,230	21,816	2,604,264	0.8	－	0.6	0.2	0.0
オ ラ ン ダ	46,640	55,891	6,671,821	2.0	－	1.3	0.5	0.2
ベ ル ギ ー	58,880	72,640	8,671,119	2.6	－	2.0	0.3	0.3
フ ラ ン ス	237,240	287,269	34,291,413	10.2	－	6.9	2.3	0.9
ド イ ツ	178,790	214,538	25,609,478	7.6	－	4.5	2.4	0.7
ス ペ イ ン	138,830	168,809	20,150,842	6.0	－	4.2	1.3	0.5
イ タ リ ア	227,440	259,095	30,928,195	9.2	－	5.4	3.0	0.8
フィンランド	14,750	16,900	2,017,364	0.6	－	0.4	0.1	0.0
オーストリア	36,220	44,139	5,268,925	1.6	－	1.0	0.4	0.2
合 計	－	－	千円 339,429,470	100.6	－	56.3	32.3	12.1

(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	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間 評 価 額		末 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	9,043	965,592	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国 債 証 券	2.5000	5,160	5,676	606,069	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国 債 証 券	2.2500	3,780	4,050	432,472	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23	国 債 証 券	1.7500	8,180	8,508	908,450	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国 債 証 券	2.5000	10,750	11,616	1,240,317	2024/01/31
US T N/B 1.875 01/31/22	国 債 証 券	1.8750	6,840	7,024	749,990	2022/01/31
US T N/B 2.5 01/15/22	国 債 証 券	2.5000	14,320	14,832	1,583,713	2022/01/15
US T N/B 2.375 01/31/23	国 債 証 券	2.3750	2,760	2,915	311,307	2023/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国 債 証 券	1.5000	8,790	9,362	999,657	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国 債 証 券	1.3750	960	1,006	107,472	2025/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26	国 債 証 券	6.0000	800	1,049	112,081	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国 債 証 券	3.1250	2,960	3,978	424,776	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国 債 証 券	3.1250	4,760	6,389	682,252	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国 債 証 券	2.5000	4,320	5,293	565,134	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国 債 証 券	3.5000	3,170	4,455	475,696	2039/02/15
US T N/B 5.25 02/15/29	国 債 証 券	5.2500	830	1,155	123,402	2029/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国 債 証 券	5.3750	2,300	3,409	364,020	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国 債 証 券	4.5000	2,320	3,530	376,997	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国 債 証 券	4.7500	1,470	2,419	258,283	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国 債 証 券	3.6250	6,540	9,489	1,013,209	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国 債 証 券	3.0000	7,830	10,686	1,141,021	2049/02/15
US T N/B 2.0 02/15/22	国 債 証 券	2.0000	10,000	10,296	1,099,355	2022/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国 債 証 券	4.3750	1,210	1,868	199,490	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国 債 証 券	4.6250	2,790	4,493	479,763	2040/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国 債 証 券	1.6250	12,850	13,726	1,465,568	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国 債 証 券	2.5000	5,690	6,945	741,603	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国 債 証 券	3.0000	6,460	8,703	929,255	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国 債 証 券	3.0000	6,600	8,936	954,128	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国 債 証 券	2.7500	11,930	13,013	1,389,400	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国 債 証 券	2.0000	12,140	13,081	1,396,743	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国 債 証 券	2.6250	7,260	8,487	906,259	2029/02/15
US T N/B 1.75 02/28/22	国 債 証 券	1.7500	10,500	10,774	1,150,425	2022/02/28
US T N/B 2.75 02/15/28	国 債 証 券	2.7500	6,640	7,726	824,988	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23	国 債 証 券	2.0000	9,070	9,499	1,014,251	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国 債 証 券	2.2500	6,690	7,454	795,876	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国 債 証 券	2.1250	3,330	3,559	380,043	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23	国 債 証 券	1.5000	7,620	7,884	841,872	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26	国 債 証 券	2.5000	5,520	6,168	658,621	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国 債 証 券	2.7500	6,290	7,000	747,451	2025/02/28
US T N/B 1.875 02/28/22	国 債 証 券	1.8750	2,440	2,508	267,845	2022/02/28
US T N/B 2.5 02/15/22	国 債 証 券	2.5000	7,160	7,429	793,290	2022/02/15
US T N/B 2.375 02/29/24	国 債 証 券	2.3750	5,800	6,251	667,452	2024/02/29
US T N/B 2.625 02/28/23	国 債 証 券	2.6250	1,370	1,458	155,759	2023/02/28
US T N/B 2.0 02/15/50	国 債 証 券	2.0000	7,850	8,871	947,234	2050/02/15
US T N/B 1.125 02/28/22	国 債 証 券	1.1250	10,000	10,158	1,084,591	2022/02/28
US T N/B 1.375 02/15/23	国 債 証 券	1.3750	2,870	2,958	315,922	2023/02/15
US T N/B 1.5 02/15/30	国 債 証 券	1.5000	11,550	12,437	1,327,995	2030/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国 債 証 券	1.1250	7,790	8,086	863,383	2025/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24	国 債 証 券	2.1250	3,400	3,638	388,485	2024/03/31
US T N/B 1.75 03/31/22	国 債 証 券	1.7500	5,290	5,436	580,433	2022/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国 債 証 券	1.5000	3,810	3,946	421,349	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国 債 証 券	2.6250	4,430	4,912	524,465	2025/03/31

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 価		償還年月日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.25 03/31/26	国 債 証 券	2.2500	1,450	1,601	170,999	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国 債 証 券	2.5000	6,720	7,145	762,898	2023/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国 債 証 券	0.6250	2,740	2,761	294,823	2027/03/31
US T N/B 0.375 03/31/22	国 債 証 券	0.3750	14,270	14,317	1,528,726	2022/03/31
US T N/B 0.5 03/15/23	国 債 証 券	0.5000	7,000	7,055	753,272	2023/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国 債 証 券	2.8750	4,220	4,736	505,728	2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国 債 証 券	2.0000	2,060	2,197	234,620	2024/04/30
US T N/B 1.875 04/30/22	国 債 証 券	1.8750	10,390	10,711	1,143,660	2022/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国 債 証 券	2.3750	8,680	9,658	1,031,241	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/15/22	国 債 証 券	2.2500	8,560	8,877	947,903	2022/04/15
US T N/B 2.75 04/30/23	国 債 証 券	2.7500	10,670	11,441	1,221,563	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国 債 証 券	2.2500	8,000	8,608	919,089	2024/04/30
US T N/B 0.125 04/30/22	国 債 証 券	0.1250	5,670	5,663	604,711	2022/04/30
US T N/B 0.25 04/15/23	国 債 証 券	0.2500	8,130	8,139	869,074	2023/04/15
US T N/B 0.375 04/30/25	国 債 証 券	0.3750	1,230	1,232	131,622	2025/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国 債 証 券	6.2500	1,210	1,860	198,601	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国 債 証 券	4.3750	1,840	2,884	307,976	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国 債 証 券	4.3750	3,150	4,968	530,500	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国 債 証 券	3.0000	2,310	3,045	325,139	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国 債 証 券	4.2500	690	1,059	113,096	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国 債 証 券	2.8750	8,730	11,297	1,206,198	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国 債 証 券	3.3750	6,110	8,559	913,922	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国 債 証 券	3.0000	4,560	6,061	647,158	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国 債 証 券	3.0000	6,000	8,088	863,585	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国 債 証 券	2.5000	5,890	7,225	771,502	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国 債 証 券	3.1250	6,660	9,229	985,468	2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国 債 証 券	1.7500	1,250	1,286	137,388	2022/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国 債 証 券	2.8750	8,200	10,963	1,170,589	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国 債 証 券	4.5000	2,250	3,526	376,508	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国 債 証 券	1.7500	20,000	20,890	2,230,492	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国 債 証 券	2.5000	12,970	14,093	1,504,787	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国 債 証 券	2.1250	7,190	7,814	834,308	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国 債 証 券	2.8750	13,300	15,655	1,671,543	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国 債 証 券	2.3750	10,760	12,386	1,322,518	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国 債 証 券	2.3750	8,430	9,489	1,013,212	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国 債 証 券	5.0000	890	1,451	154,965	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国 債 証 券	1.6250	14,030	15,002	1,601,788	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国 債 証 券	1.6250	1,460	1,520	162,326	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国 債 証 券	2.0000	6,910	7,378	787,811	2024/05/31
US T N/B 1.25 05/15/50	国 債 証 券	1.2500	6,000	5,683	606,799	2050/05/15
US T N/B 1.75 05/31/22	国 債 証 券	1.7500	9,490	9,775	1,043,723	2022/05/31
US T N/B 2.125 05/31/26	国 債 証 券	2.1250	6,070	6,669	712,093	2026/05/31
US T N/B 2.75 05/31/23	国 債 証 券	2.7500	3,880	4,168	445,046	2023/05/31
US T N/B 2.875 05/31/25	国 債 証 券	2.8750	4,550	5,114	546,111	2025/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国 債 証 券	0.1250	8,630	8,608	919,085	2023/05/15
US T N/B 1.375 06/30/23	国 債 証 券	1.3750	1,390	1,438	153,593	2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国 債 証 券	2.0000	7,540	8,060	860,644	2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国 債 証 券	2.1250	3,820	3,968	423,729	2022/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国 債 証 券	2.7500	8,100	9,068	968,279	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国 債 証 券	1.8750	6,470	7,014	748,980	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国 債 証 券	2.6250	8,780	9,415	1,005,331	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国 債 証 券	1.7500	7,510	7,953	849,201	2024/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国 債 証 券	1.7500	5,160	5,320	568,106	2022/06/30
US T N/B 1.75 06/15/22	国 債 証 券	1.7500	3,700	3,814	407,224	2022/06/15
US T N/B 2.125 07/31/24	国 債 証 券	2.1250	3,520	3,786	404,281	2024/07/31

銘	柄	当		期			末
		種	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 1.25 07/31/23		国 債 証 券	1.2500	8,400	8,667	925,455	2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25		国 債 証 券	2.8750	2,990	3,371	359,945	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22		国 債 証 券	1.8750	10,290	10,651	1,137,288	2022/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23		国 債 証 券	2.7500	10,070	10,858	1,159,339	2023/07/31
US T N/B 1.75 07/15/22		国 債 証 券	1.7500	2,940	3,033	323,921	2022/07/15
US T N/B 6.25 08/15/23		国 債 証 券	6.2500	1,200	1,427	152,437	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41		国 債 証 券	3.7500	1,170	1,708	182,433	2041/08/15
US T N/B 5.5 08/15/28		国 債 証 券	5.5000	930	1,295	138,277	2028/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40		国 債 証 券	3.8750	1,460	2,159	230,562	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42		国 債 証 券	2.7500	4,000	5,075	541,924	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44		国 債 証 券	3.1250	3,930	5,308	566,796	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39		国 債 証 券	4.5000	2,510	3,971	423,993	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43		国 債 証 券	3.6250	4,350	6,293	671,964	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45		国 債 証 券	2.8750	6,340	8,269	882,906	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25		国 債 証 券	2.0000	9,350	10,131	1,081,751	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47		国 債 証 券	2.7500	8,980	11,608	1,239,391	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49		国 債 証 券	2.2500	7,730	9,178	980,017	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23		国 債 証 券	2.5000	6,700	7,179	766,607	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24		国 債 証 券	2.3750	14,120	15,338	1,637,740	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46		国 債 証 券	2.2500	4,060	4,759	508,127	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48		国 債 証 券	3.0000	7,030	9,557	1,020,454	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27		国 債 証 券	2.2500	9,290	10,407	1,111,230	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26		国 債 証 券	1.5000	8,500	9,035	964,691	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28		国 債 証 券	2.8750	10,270	12,130	1,295,187	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25		国 債 証 券	2.7500	8,140	9,139	975,845	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23		国 債 証 券	1.3750	9,500	9,848	1,051,559	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29		国 債 証 券	1.6250	9,900	10,763	1,149,182	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24		国 債 証 券	1.8750	7,320	7,806	833,517	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23		国 債 証 券	2.7500	7,030	7,594	810,816	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22		国 債 証 券	1.6250	3,280	3,382	361,122	2022/08/31
US T N/B 1.5 08/15/22		国 債 証 券	1.5000	11,300	11,616	1,240,292	2022/08/15
US T N/B 1.5 08/31/21		国 債 証 券	1.5000	13,560	13,773	1,470,592	2021/08/31
US T N/B 1.375 08/31/26		国 債 証 券	1.3750	6,000	6,331	676,054	2026/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25		国 債 証 券	3.0000	7,430	8,451	902,380	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/21		国 債 証 券	2.1250	9,800	10,042	1,072,259	2021/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23		国 債 証 券	1.3750	9,000	9,338	997,039	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22		国 債 証 券	1.7500	5,360	5,548	592,406	2022/09/30
US T N/B 1.125 09/30/21		国 債 証 券	1.1250	430	435	46,463	2021/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22		国 債 証 券	1.8750	8,860	9,197	981,973	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23		国 債 証 券	2.8750	7,810	8,484	905,925	2023/09/30
US T N/B 2.75 09/15/21		国 債 証 券	2.7500	2,960	3,053	326,026	2021/09/15
US T N/B 1.5 09/15/22		国 債 証 券	1.5000	8,410	8,653	923,926	2022/09/15
US T N/B 1.5 09/30/21		国 債 証 券	1.5000	20,880	21,229	2,266,716	2021/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26		国 債 証 券	1.6250	820	878	93,789	2026/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24		国 債 証 券	2.2500	4,560	4,944	527,950	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25		国 債 証 券	3.0000	6,560	7,472	797,812	2025/10/31
US T N/B 1.25 10/31/21		国 債 証 券	1.2500	10,500	10,650	1,137,200	2021/10/31
US T N/B 2.875 10/15/21		国 債 証 券	2.8750	13,100	13,559	1,447,695	2021/10/15
US T N/B 1.625 10/31/23		国 債 証 券	1.6250	1,780	1,862	198,884	2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22		国 債 証 券	2.0000	4,280	4,461	476,325	2022/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23		国 債 証 券	2.8750	9,290	10,108	1,079,303	2023/10/31
US T N/B 1.5 10/31/21		国 債 証 券	1.5000	9,100	9,262	988,951	2021/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26		国 債 証 券	1.6250	100	107	11,442	2026/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21		国 債 証 券	8.0000	2,100	2,328	248,661	2021/11/15
US T N/B 5.25 11/15/28		国 債 証 券	5.2500	1,700	2,350	250,936	2028/11/15

銘	柄	当		利	率	額	面	金	額	期		末					
		種	類							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	円		
US T N/B 6.125 11/15/27		国	債	証	券	6.1250		2,050		2,884		308,003				2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44		国	債	証	券	3.0000		4,400		5,833		622,872				2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40		国	債	証	券	4.2500		1,040		1,612		172,199				2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42		国	債	証	券	2.7500		4,620		5,856		625,344				2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41		国	債	証	券	3.1250		2,350		3,152		336,591				2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43		国	債	証	券	3.7500		4,190		6,179		659,795				2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47		国	債	証	券	2.7500		4,650		6,015		642,244				2047/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45		国	債	証	券	3.0000		4,950		6,605		705,232				2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46		国	債	証	券	2.8750		5,750		7,564		807,650				2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24		国	債	証	券	2.2500	13,850		15,028		1,604,575					2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39		国	債	証	券	4.3750	620		967		103,350					2039/11/15	
US T N/B 3.375 11/15/48		国	債	証	券	3.3750	7,560		10,982		1,172,556					2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49		国	債	証	券	2.3750	7,470		9,108		972,476					2049/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/21		国	債	証	券	2.0000	7,900		8,099		864,734					2021/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25		国	債	証	券	2.2500	3,890		4,279		456,868					2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28		国	債	証	券	3.1250	9,770		11,782		1,258,046					2028/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/22		国	債	証	券	1.6250	20,000		20,678		2,207,886					2022/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/23		国	債	証	券	2.7500	13,330		14,457		1,543,663					2023/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26		国	債	証	券	2.0000	8,900		9,750		1,041,046					2026/11/15	
US T N/B 2.0 11/30/22		国	債	証	券	2.0000	12,020		12,544		1,339,422					2022/11/30	
US T N/B 2.25 11/15/27		国	債	証	券	2.2500	12,060		13,543		1,446,087					2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/24		国	債	証	券	2.1250	3,970		4,288		457,853					2024/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/25		国	債	証	券	2.8750	6,780		7,685		820,552					2025/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/23		国	債	証	券	2.8750	9,810		10,689		1,141,353					2023/11/30	
US T N/B 1.75 11/30/21		国	債	証	券	1.7500	1,380		1,410		150,646					2021/11/30	
US T N/B 2.875 11/15/21		国	債	証	券	2.8750	8,440		8,754		934,755					2021/11/15	
US T N/B 1.5 11/30/21		国	債	証	券	1.5000	2,460		2,506		267,630					2021/11/30	
US T N/B 1.625 11/30/26		国	債	証	券	1.6250	310		332		35,482					2026/11/30	
US T N/B 1.75 11/15/29		国	債	証	券	1.7500	13,240		14,565		1,555,108					2029/11/15	
US T N/B 1.5 11/30/24		国	債	証	券	1.5000	1,510		1,590		169,775					2024/11/30	
US T N/B 2.625 12/31/23		国	債	証	券	2.6250	9,670		10,472		1,118,128					2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25		国	債	証	券	2.6250	7,300		8,187		874,230					2025/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/21		国	債	証	券	2.1250	7,000		7,201		768,935					2021/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24		国	債	証	券	2.2500	4,530		4,926		525,989					2024/12/31	
US T N/B 2.125 12/31/22		国	債	証	券	2.1250	13,500		14,150		1,510,874					2022/12/31	
US T N/B 2.625 12/15/21		国	債	証	券	2.6250	11,320		11,727		1,252,118					2021/12/15	
US T N/B 1.625 12/31/21		国	債	証	券	1.6250	3,070		3,137		334,998					2021/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26		国	債	証	券	1.7500	4,990		5,391		575,696					2026/12/31	
US T N/B 1.625 12/15/22		国	債	証	券	1.6250	8,600		8,903		950,610					2022/12/15	
US T N/B 1.75 12/31/24		国	債	証	券	1.7500	600		638		68,221					2024/12/31	
小	計	—	—	—	—	1,299,750		1,450,949		154,917,910					—		
(カナダ)						千	カ	ナ	ダ	・	ド	ル	千	円			
CANADA 1.5 02/01/22		国	債	証	券	1.5000	3,050		3,112		243,895					2022/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24		国	債	証	券	2.2500	3,190		3,414		267,600					2024/03/01	
CANADA 0.5 03/01/22		国	債	証	券	0.5000	4,170		4,188		328,257					2022/03/01	
CANADA 1.75 03/01/23		国	債	証	券	1.7500	5,070		5,266		412,772					2023/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25		国	債	証	券	1.2500	2,060		2,145		168,161					2025/03/01	
CANADA 1.5 05/01/22		国	債	証	券	1.5000	1,580		1,616		126,699					2022/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26		国	債	証	券	1.5000	2,450		2,610		204,552					2026/06/01	
CANADA 8.0 06/01/27		国	債	証	券	8.0000	920		1,393		109,241					2027/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29		国	債	証	券	5.7500	1,230		1,794		140,602					2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33		国	債	証	券	5.7500	1,860		3,019		236,676					2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37		国	債	証	券	5.0000	1,950		3,228		253,025					2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24		国	債	証	券	2.5000	3,600		3,905		306,037					2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41		国	債	証	券	4.0000	2,450		3,874		303,637					2041/06/01	

銘	柄	当		期	価		末		
		種	利 率		額 面 金 額	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 2.75 06/01/22	国 債 証 券	2.7500	3,350	3,511	275,225	2022/06/01			
CANADA 1.5 06/01/23	国 債 証 券	1.5000	3,130	3,238	253,807	2023/06/01			
CANADA 2.0 06/01/28	国 債 証 券	2.0000	1,060	1,187	93,029	2028/06/01			
CANADA 2.25 06/01/25	国 債 証 券	2.2500	1,840	2,009	157,490	2025/06/01			
CANADA 1.0 06/01/27	国 債 証 券	1.0000	2,620	2,721	213,257	2027/06/01			
CANADA 2.25 06/01/29	国 債 証 券	2.2500	1,480	1,707	133,794	2029/06/01			
CANADA 1.25 06/01/30	国 債 証 券	1.2500	3,320	3,548	278,089	2030/06/01			
CANADA 0.25 08/01/22	国 債 証 券	0.2500	1,600	1,598	125,254	2022/08/01			
CANADA 1.5 09/01/24	国 債 証 券	1.5000	1,410	1,478	115,836	2024/09/01			
CANADA 2.0 09/01/23	国 債 証 券	2.0000	3,080	3,244	254,235	2023/09/01			
CANADA 1.0 09/01/22	国 債 証 券	1.0000	3,180	3,230	253,194	2022/09/01			
CANADA 0.5 09/01/25	国 債 証 券	0.5000	2,220	2,233	175,007	2025/09/01			
CANADA 1.25 11/01/21	国 債 証 券	1.2500	4,300	4,360	341,742	2021/11/01			
CANADA 3.5 12/01/45	国 債 証 券	3.5000	2,510	3,918	307,107	2045/12/01			
CANADA 2.75 12/01/48	国 債 証 券	2.7500	2,840	4,062	318,403	2048/12/01			
CANADA 2.0 12/01/51	国 債 証 券	2.0000	1,790	2,267	177,694	2051/12/01			
CANADA 2.75 12/01/64	国 債 証 券	2.7500	670	1,085	85,093	2064/12/01			
小 計	—	—	73,980	84,974	6,659,420	—			
(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	2,120	2,705	197,131	2047/03/21			
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国 債 証 券	3.2500	3,880	4,412	321,526	2025/04/21			
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国 債 証 券	4.7500	5,540	7,088	516,479	2027/04/21			
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国 債 証 券	2.7500	5,220	5,706	415,766	2024/04/21			
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国 債 証 券	4.2500	5,200	6,327	461,034	2026/04/21			
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国 債 証 券	5.5000	7,140	8,196	597,173	2023/04/21			
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国 債 証 券	3.2500	4,680	5,661	412,492	2029/04/21			
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国 債 証 券	4.5000	2,890	4,111	299,544	2033/04/21			
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国 債 証 券	3.7500	2,050	2,789	203,206	2037/04/21			
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国 債 証 券	2.2500	4,340	4,848	353,240	2028/05/21			
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国 債 証 券	2.5000	4,050	4,679	340,954	2030/05/21			
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国 債 証 券	2.7500	950	1,143	83,345	2041/05/21			
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国 債 証 券	1.2500	1,000	1,031	75,167	2032/05/21			
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国 債 証 券	3.2500	1,370	1,763	128,484	2039/06/21			
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国 債 証 券	1.5000	3,520	3,730	271,794	2031/06/21			
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国 債 証 券	2.7500	2,620	3,177	231,532	2035/06/21			
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国 債 証 券	5.7500	4,040	4,495	327,538	2022/07/15			
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国 債 証 券	2.7500	5,590	6,497	473,413	2028/11/21			
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国 債 証 券	2.7500	4,270	4,914	358,059	2027/11/21			
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国 債 証 券	2.7500	3,430	4,021	292,994	2029/11/21			
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国 債 証 券	2.2500	5,730	6,005	437,561	2022/11/21			
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国 債 証 券	0.2500	3,210	3,195	232,817	2024/11/21			
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国 債 証 券	1.0000	4,500	4,540	330,846	2030/12/21			
小 計	—	—	87,340	101,044	7,362,104	—			
(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	612	46,816	2024/02/01			
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国 債 証 券	1.7500	1,700	1,762	134,585	2023/02/01			
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国 債 証 券	3.5000	1,130	1,336	102,060	2027/03/01			
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国 債 証 券	2.7500	1,100	1,437	109,811	2046/03/01			
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国 債 証 券	1.8750	330	374	28,582	2050/03/01			
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国 債 証 券	2.7500	730	935	71,425	2042/04/01			
SINGAPORE 1.75 04/01/22	国 債 証 券	1.7500	1,740	1,784	136,335	2022/04/01			
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国 債 証 券	2.6250	1,020	1,161	88,697	2028/05/01			
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国 債 証 券	2.3750	920	1,001	76,523	2025/06/01			
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国 債 証 券	2.1250	570	619	47,337	2026/06/01			
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国 債 証 券	2.8750	1,070	1,254	95,784	2029/07/01			

銘	柄	当			期			末			
		種	利	率	額	面	金	額	償還年月日		
										外	貨
(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 2.375 07/01/39	国	債	証	券	2.3750	470	560	42,785	2039/07/01		
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国	債	証	券	2.7500	370	396	30,264	2023/07/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国	債	証	券	2.2500	510	588	44,913	2036/08/01		
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国	債	証	券	3.0000	1,970	2,176	166,239	2024/09/01		
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国	債	証	券	3.1250	1,670	1,772	135,373	2022/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国	債	証	券	2.8750	450	533	40,764	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国	債	証	券	3.3750	1,100	1,411	107,837	2033/09/01		
小計	—	—	—	—	17,430	19,719	1,506,137	—	—		
(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	4,380	6,787	894,423	2044/01/22		
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国	債	証	券	3.5000	3,190	5,190	684,039	2045/01/22		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国	債	証	券	4.0000	2,480	5,424	714,841	2060/01/22		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国	債	証	券	1.7500	2,720	3,452	454,969	2049/01/22		
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国	債	証	券	0.1250	3,000	3,008	396,502	2023/01/31		
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国	債	証	券	5.0000	2,780	3,433	452,458	2025/03/07		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国	債	証	券	4.2500	3,260	5,083	669,922	2036/03/07		
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国	債	証	券	1.0000	6,690	6,952	916,202	2024/04/22		
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国	債	証	券	4.2500	3,580	5,212	686,853	2032/06/07		
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国	債	証	券	0.6250	2,080	2,143	282,503	2025/06/07		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国	債	証	券	1.5000	2,890	3,454	455,184	2047/07/22		
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国	債	証	券	3.7500	2,280	4,304	567,265	2052/07/22		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国	債	証	券	1.7500	2,680	3,665	483,066	2057/07/22		
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国	債	証	券	2.5000	2,670	4,651	613,001	2065/07/22		
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国	債	証	券	3.5000	2,400	5,297	698,107	2068/07/22		
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国	債	証	券	1.5000	2,390	2,607	343,570	2026/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国	債	証	券	1.2500	3,860	4,181	551,063	2027/07/22		
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国	債	証	券	0.5000	2,680	2,710	357,210	2022/07/22		
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国	債	証	券	0.7500	2,090	2,139	282,002	2023/07/22		
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国	債	証	券	4.2500	1,930	3,192	420,721	2039/09/07		
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国	債	証	券	2.2500	3,830	4,110	541,644	2023/09/07		
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国	債	証	券	2.7500	2,500	2,792	367,995	2024/09/07		
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国	債	証	券	2.0000	4,330	4,791	631,452	2025/09/07		
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国	債	証	券	4.5000	3,320	5,160	680,108	2034/09/07		
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国	債	証	券	1.7500	3,560	4,226	556,959	2037/09/07		
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国	債	証	券	1.7500	7,000	7,277	958,998	2022/09/07		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国	債	証	券	1.6250	1,600	2,067	272,399	2054/10/22		
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国	債	証	券	1.6250	1,920	2,841	374,423	2071/10/22		
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国	債	証	券	1.2500	1,000	1,112	146,631	2041/10/22		
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国	債	証	券	1.6250	3,240	3,648	480,862	2028/10/22		
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国	債	証	券	0.8750	4,140	4,403	580,293	2029/10/22		
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国	債	証	券	6.0000	1,450	2,161	284,810	2028/12/07		
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国	債	証	券	4.7500	1,980	3,416	450,198	2038/12/07		
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国	債	証	券	4.5000	3,310	5,937	782,397	2042/12/07		
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国	債	証	券	4.2500	3,520	6,519	859,125	2046/12/07		
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国	債	証	券	4.2500	4,020	8,589	1,131,981	2055/12/07		
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国	債	証	券	4.2500	2,280	2,986	393,516	2027/12/07		
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国	債	証	券	4.2500	3,360	5,665	746,572	2040/12/07		
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国	債	証	券	4.7500	3,120	4,575	602,915	2030/12/07		
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国	債	証	券	4.2500	1,930	3,747	493,893	2049/12/07		
小計	—	—	—	—	121,440	168,926	22,261,093	—	—		
(イスラエル)				%	千イスラエル・シェケル		千イスラエル・シェケル		千円		
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国	債	証	券	5.5000	4,670	8,253	255,103	2042/01/31		
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国	債	証	券	3.7500	1,730	2,529	78,194	2047/03/31		
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国	債	証	券	2.0000	6,700	7,393	228,526	2027/03/31		
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国	債	証	券	4.2500	7,960	8,868	274,139	2023/03/31		

銘	柄	当		期			末
		種	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イスラエル)			%	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25		国 債 証 券	1.7500	5,210	5,588	172,741	2025/08/31
小 計		—	—	26,270	32,633	1,008,704	—
(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	21,050	39,448	631,573	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25		国 債 証 券	1.7500	14,100	15,828	253,414	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23		国 債 証 券	1.5000	15,100	16,168	258,853	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27		国 債 証 券	0.5000	16,390	17,476	279,794	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29		国 債 証 券	0.5000	10,040	10,792	172,784	2029/11/15
DENMARK 0.25 11/15/22		国 債 証 券	0.2500	10,000	10,200	163,302	2022/11/15
小 計		—	—	86,680	109,914	1,759,723	—
(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	8,270	8,769	96,908	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27		国 債 証 券	1.7500	2,870	3,106	34,331	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24		国 債 証 券	3.0000	11,760	12,937	142,956	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25		国 債 証 券	1.7500	10,070	10,722	118,487	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28		国 債 証 券	2.0000	10,510	11,676	129,026	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23		国 債 証 券	2.0000	5,560	5,845	64,594	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30		国 債 証 券	1.3750	7,410	7,926	87,583	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29		国 債 証 券	1.7500	1,970	2,168	23,963	2029/09/06
小 計		—	—	58,420	63,153	697,851	—
(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	7,780	11,889	134,113	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28		国 債 証 券	0.7500	11,710	12,491	140,907	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25		国 債 証 券	2.5000	17,950	20,397	230,087	2025/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22		国 債 証 券	3.5000	10	10	121	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23		国 債 証 券	1.5000	15,060	16,003	180,517	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26		国 債 証 券	1.0000	4,010	4,314	48,662	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29		国 債 証 券	0.7500	7,310	7,818	88,192	2029/11/12
小 計		—	—	63,830	72,925	822,600	—
(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	38,727	182,795	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/09/23		国 債 証 券	6.7500	62,560	65,532	309,315	2023/03/09
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29		国 債 証 券	8.5000	48,201	56,763	267,925	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31		国 債 証 券	7.7500	2,315	2,606	12,301	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27		国 債 証 券	7.5000	43,175	47,701	225,150	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22		国 債 証 券	6.5000	57,079	58,835	277,702	2022/06/09
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24		国 債 証 券	8.0000	40,030	44,431	209,715	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42		国 債 証 券	7.7500	26,328	28,593	134,962	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47		国 債 証 券	8.0000	33,666	37,536	177,174	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38		国 債 証 券	8.5000	37,143	43,742	206,466	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36		国 債 証 券	10.0000	21,473	28,848	136,164	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34		国 債 証 券	7.7500	20,241	22,885	108,020	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24		国 債 証 券	10.0000	31,873	38,071	179,698	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23		国 債 証 券	8.0000	36,863	40,433	190,844	2023/12/07
小 計		—	—	499,011	554,711	2,618,237	—
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 4.736 03/15/46		国 債 証 券	4.7360	3,500	3,893	97,176	2046/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23		国 債 証 券	3.4800	3,910	4,033	100,675	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国 債 証 券	4.3920	1,480	1,615	40,334	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国 債 証 券	4.4980	2,820	3,148	78,583	2030/04/15
MALAYSIA 4.127 04/15/32		国 債 証 券	4.1270	1,180	1,272	31,758	2032/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国 債 証 券	3.8440	1,340	1,406	35,097	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国 債 証 券	4.7620	5,540	6,383	159,324	2037/04/07
MALAYSIA 3.502 05/31/27		国 債 証 券	3.5020	4,580	4,802	119,860	2027/05/31
MALAYSIA 4.232 06/30/31		国 債 証 券	4.2320	2,000	2,183	54,491	2031/06/30

銘 柄	当		期			末	
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		千円	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国 債 証 券	4.1810	2,190	2,330		58,166	2024/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国 債 証 券	3.8280	2,000	2,113		52,746	2034/07/05
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国 債 証 券	3.4180	5,000	5,122		127,860	2022/08/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国 債 証 券	3.8850	2,760	2,977		74,305	2029/08/15
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国 債 証 券	3.8000	3,700	3,857		96,279	2023/08/17
MALAYSIA 5.248 09/15/28	国 債 証 券	5.2480	1,480	1,727		43,111	2028/09/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国 債 証 券	3.9550	4,400	4,701		117,359	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国 債 証 券	4.9350	3,470	4,079		101,830	2043/09/30
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国 債 証 券	4.0590	1,840	1,956		48,845	2024/09/30
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国 債 証 券	3.7950	1,790	1,850		46,196	2022/09/30
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国 債 証 券	3.9000	1,500	1,604		40,055	2026/11/30
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国 債 証 券	4.6420	1,050	1,190		29,704	2033/11/07
小 計	—	—	57,530	62,250		1,553,765	—
(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	9,120	9,632		257,383	2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29	国 債 証 券	5.7500	1,800	2,469		65,980	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国 債 証 券	2.7500	5,790	6,428		171,780	2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国 債 証 券	2.2500	4,840	5,029		134,397	2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国 債 証 券	2.5000	4,850	5,210		139,229	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国 債 証 券	2.5000	6,060	6,594		176,209	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国 債 証 券	3.2500	7,180	8,057		215,296	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国 債 証 券	2.5000	6,230	6,791		181,476	2027/07/25
POLAND 07/25/22	国 債 証 券	—	2,640	2,624		70,138	2022/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国 債 証 券	5.7500	8,690	9,769		261,047	2022/09/23
POLAND 4.0 10/25/23	国 債 証 券	4.0000	1,610	1,798		48,058	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国 債 証 券	2.7500	4,360	4,903		131,014	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国 債 証 券	2.2500	6,880	7,353		196,480	2024/10/25
小 計	—	—	70,050	76,665		2,048,493	—
(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	1,400	1,880		224,517	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国 債 証 券	1.3500	1,180	1,344		160,438	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国 債 証 券	3.4000	1,210	1,383		165,180	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国 債 証 券	5.4000	1,030	1,312		156,673	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国 債 証 券	3.9000	1,400	1,568		187,273	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国 債 証 券	0.8000	620	634		75,704	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50	国 債 証 券	1.5000	770	943		112,676	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国 債 証 券	1.3000	800	916		109,395	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国 債 証 券	2.4000	1,680	2,078		248,154	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国 債 証 券	0.9000	1,970	2,131		254,394	2028/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国 債 証 券	1.0000	1,700	1,827		218,152	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国 債 証 券	1.7000	1,130	1,380		164,784	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国 債 証 券	0.4000	2,770	2,817		336,308	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国 債 証 券	0.2000	570	584		69,829	2027/05/15
IRISH 10/18/22	国 債 証 券	0.0000	1,000	1,011		120,780	2022/10/18
小 計	—	—	19,230	21,816		2,604,264	—
(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	714		85,267	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国 債 証 券	3.7500	2,310	4,193		500,597	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国 債 証 券	2.7500	2,700	4,641		554,101	2047/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国 債 証 券	3.7500	1,670	1,859		221,953	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国 債 証 券	5.5000	3,020	4,393		524,415	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国 債 証 券	4.0000	2,260	3,803		454,006	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国 債 証 券	2.5000	1,000	1,343		160,407	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国 債 証 券	0.5000	1,570	1,730		206,580	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国 債 証 券	0.0000	5,190	5,239		625,462	2022/01/15

銘	柄	当		額 面 金 額	期 価 額		末
		種 類	利 率		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 01/15/24		国 債 証 券	0.0000	3,030	3,097	369,733	2024/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23		国 債 証 券	1.7500	3,420	3,670	438,098	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26		国 債 証 券	0.5000	520	551	65,886	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22		国 債 証 券	2.2500	850	901	107,572	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24		国 債 証 券	2.0000	3,600	3,986	475,867	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25		国 債 証 券	0.2500	2,630	2,739	327,008	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28		国 債 証 券	0.7500	1,660	1,817	216,906	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27		国 債 証 券	0.7500	3,670	3,984	475,660	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29		国 債 証 券	0.2500	3,250	3,424	408,807	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30		国 債 証 券	0.0000	3,700	3,799	453,488	2030/07/15
小 計		—	—	46,640	55,891	6,671,821	—
(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	3,190	3,450	411,845	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28		国 債 証 券	5.5000	3,750	5,441	649,537	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41		国 債 証 券	4.2500	2,350	4,120	491,834	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26		国 債 証 券	4.5000	2,220	2,852	340,448	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32		国 債 証 券	4.0000	1,550	2,277	271,900	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35		国 債 証 券	5.0000	2,950	5,027	600,144	2035/03/28
BELGIUM 3.75 06/22/45		国 債 証 券	3.7500	1,670	2,931	349,991	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47		国 債 証 券	1.6000	1,640	2,059	245,847	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50		国 債 証 券	1.7000	1,550	2,011	240,076	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57		国 債 証 券	2.2500	830	1,262	150,647	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66		国 債 証 券	2.1500	1,110	1,726	206,104	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26		国 債 証 券	1.0000	3,770	4,080	487,139	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24		国 債 証 券	2.6000	2,490	2,802	334,536	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31		国 債 証 券	1.0000	1,610	1,792	213,991	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23		国 債 証 券	2.2500	1,680	1,822	217,609	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28		国 債 証 券	0.8000	3,390	3,595	429,186	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40		国 債 証 券	0.4000	2,440	2,425	289,487	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29		国 債 証 券	0.9000	1,400	1,535	183,260	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34		国 債 証 券	3.0000	1,420	1,986	237,175	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38		国 債 証 券	1.9000	1,930	2,459	293,545	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25		国 債 証 券	0.8000	2,430	2,581	308,191	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27		国 債 証 券	0.8000	1,930	2,077	248,003	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37		国 債 証 券	1.4500	1,000	1,192	142,340	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30		国 債 証 券	0.1000	1,770	1,804	215,383	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/21		国 債 証 券	4.2500	4,480	4,753	567,470	2021/09/28
BELGIUM 4.25 09/28/22		国 債 証 券	4.2500	1,350	1,499	179,003	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24		国 債 証 券	0.5000	950	990	118,254	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23		国 債 証 券	0.2000	2,030	2,078	248,161	2023/10/22
小 計		—	—	58,880	72,640	8,671,119	—
(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	0.0000	2,810	2,837	338,733	2022/02/25
FRANCE OAT 03/25/24		国 債 証 券	0.0000	10,170	10,380	1,239,158	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25		国 債 証 券	0.0000	3,610	3,694	441,062	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23		国 債 証 券	0.0000	4,330	4,399	525,158	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23		国 債 証 券	8.5000	1,480	1,864	222,606	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26		国 債 証 券	3.5000	7,840	9,664	1,153,635	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41		国 債 証 券	4.5000	6,240	11,434	1,364,972	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55		国 債 証 券	4.0000	2,610	5,369	640,901	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60		国 債 証 券	4.0000	2,460	5,341	637,620	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29		国 債 証 券	5.5000	7,440	11,252	1,343,267	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22		国 債 証 券	3.0000	13,130	14,004	1,671,705	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35		国 債 証 券	4.7500	4,270	7,193	858,712	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45		国 債 証 券	3.2500	4,320	7,133	851,553	2045/05/25

銘	柄	当			期			末																							
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月	日			
(ユーロ…フランス)					%			千ユーロ			千ユーロ		千円																		
FRANCE OAT 2.0 05/25/48		国	債	証	券	2.0000		3,580			4,936		589,319													2048/05/25					
FRANCE OAT 1.5 05/25/50		国	債	証	券	1.5000		4,480			5,616		670,436													2050/05/25					
FRANCE OAT 0.75 05/25/52		国	債	証	券	0.7500		3,030			3,149		375,993													2052/05/25					
FRANCE OAT 1.75 05/25/66		国	債	証	券	1.7500		2,070			2,947		351,896													2066/05/25					
FRANCE OAT 2.25 05/25/24		国	債	証	券	2.2500		8,220			9,133		1,090,291													2024/05/25					
FRANCE OAT 2.5 05/25/30		国	債	証	券	2.5000		5,550			7,017		837,707													2030/05/25					
FRANCE OAT 0.75 05/25/28		国	債	証	券	0.7500		4,850			5,246		626,222													2028/05/25					
FRANCE OAT 1.5 05/25/31		国	債	証	券	1.5000		7,930			9,308		1,111,201													2031/05/25					
FRANCE OAT 0.5 05/25/25		国	債	証	券	0.5000		7,840			8,230		982,474													2025/05/25					
FRANCE OAT 0.5 05/25/29		国	債	証	券	0.5000		6,690			7,115		849,381													2029/05/25					
FRANCE OAT 1.25 05/25/34		国	債	証	券	1.2500		3,360			3,895		465,041													2034/05/25					
FRANCE OAT 0.5 05/25/26		国	債	証	券	0.5000		12,820			13,530		1,615,127													2026/05/25					
FRANCE OAT 1.0 05/25/27		国	債	証	券	1.0000		6,120			6,693		799,018													2027/05/25					
FRANCE OAT 1.75 05/25/23		国	債	証	券	1.7500		9,570			10,225		1,220,579													2023/05/25					
FRANCE OAT 1.25 05/25/36		国	債	証	券	1.2500		6,030			7,021		838,136													2036/05/25					
FRANCE OAT 05/25/22		国	債	証	券	0.0000		5,500			5,564		664,177													2022/05/25					
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国	債	証	券	1.7500		5,110			6,478		773,351													2039/06/25					
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国	債	証	券	4.2500		10,990			12,785		1,526,217													2023/10/25					
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債	証	券	6.0000		2,220			2,998		357,912													2025/10/25					
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債	証	券	2.7500		4,800			5,901		704,415													2027/10/25					
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債	証	券	4.0000		5,170			8,637		1,031,061													2038/10/25					
FRANCE OAT 3.25 10/25/21		国	債	証	券	3.2500		4,090			4,301		513,412													2021/10/25					
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債	証	券	5.7500		5,120			8,780		1,048,117													2032/10/25					
FRANCE OAT 2.25 10/25/22		国	債	証	券	2.2500		5,090			5,431		648,406													2022/10/25					
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債	証	券	1.0000		8,080			8,727		1,041,744													2025/11/25					
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債	証	券	0.2500		2,630			2,737		326,732													2026/11/25					
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債	証	券	0.7500		6,690			7,252		865,751													2028/11/25					
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債	証	券	0.0000		8,900			9,032		1,078,197													2029/11/25					
小計		—				—		237,240			287,269		34,291,413												—						
(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			1,473		175,889													2024/01/04					
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債	証	券	5.6250		3,440			5,073		605,572													2028/01/04					
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債	証	券	6.2500		1,400			2,320		276,941													2030/01/04					
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債	証	券	5.5000		4,320			7,074		844,438													2031/01/04					
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債	証	券	4.0000		4,750			8,146		972,495													2037/01/04					
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22		国	債	証	券	2.0000		8,030			8,364		998,493													2022/01/04					
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債	証	券	0.5000		4,750			5,013		598,402													2025/02/15					
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債	証	券	0.5000		6,250			6,663		795,444													2026/02/15					
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債	証	券	0.2500		6,990			7,466		891,331													2029/02/15					
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23		国	債	証	券	1.5000		5,050			5,347		638,353													2023/02/15					
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債	証	券	0.5000		2,040			2,211		263,979													2028/02/15					
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24		国	債	証	券	1.7500		4,200			4,579		546,646													2024/02/15					
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債	証	券	0.2500		4,240			4,490		536,030													2027/02/15					
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30		国	債	証	券	0.0000		1,350			1,409		168,307													2030/02/15					
BUNDESSCHAT 0.0 03/11/22		国	債	証	券	0.0000		3,000			3,033		362,113													2022/03/11					
BUNDESUBL 04/08/22		国	債	証	券	0.0000		3,300			3,339		398,659													2022/04/08					
BUNDESUBL 04/14/23		国	債	証	券	0.0000		2,960			3,018		360,366													2023/04/14					
BUNDESUBL 04/05/24		国	債	証	券	0.0000		5,380			5,520		659,020													2024/04/05					
BUNDESUBL 0.0 04/11/25		国	債	証	券	0.0000		2,000			2,064		246,418													2025/04/11					
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24		国	債	証	券	1.5000		5,000			5,431		648,322													2024/05/15					
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23		国	債	証	券	1.5000		8,090			8,610		1,027,856													2023/05/15					
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35		国	債	証	券	0.0000		2,000			2,067		246,818													2035/05/15					
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債	証	券	6.5000		1,670			2,519		300,811													2027/07/04					
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債	証	券	4.7500		1,800			2,580		308,066													2028/07/04					
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500		3,150			5,850		698,354													2039/07/04					

銘	柄	当			期			末
		種	類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債 証 券	3.2500	3,530	6,192	739,228	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債 証 券	2.5000	4,660	7,582	905,080	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債 証 券	4.7500	2,730	5,470	652,969	2040/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22		国	債 証 券	1.7500	4,380	4,597	548,763	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債 証 券	4.7500	2,520	4,355	519,972	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債 証 券	2.5000	5,810	9,697	1,157,624	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債 証 券	1.2500	3,930	5,324	635,557	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債 証 券	1.0000	4,870	5,294	631,948	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債 証 券	0.5000	5,360	5,789	691,142	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26		国	債 証 券	0.0000	5,690	5,917	706,394	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28		国	債 証 券	0.2500	5,940	6,335	756,316	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23		国	債 証 券	2.0000	3,880	4,212	502,843	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24		国	債 証 券	1.0000	3,100	3,319	396,192	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29		国	債 証 券	0.0000	5,620	5,876	701,431	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債 証 券	0.0000	780	776	92,658	2050/08/15
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22		国	債 証 券	1.5000	3,300	3,461	413,151	2022/09/04
BUNDESSCHAT 0.0 09/10/21		国	債 証 券	0.0000	1,070	1,078	128,725	2021/09/10
BUNDESobl 10/18/24		国	債 証 券	0.0000	4,040	4,158	496,344	2024/10/18
BUNDESobl 10/08/21		国	債 証 券	0.0000	3,400	3,428	409,218	2021/10/08
BUNDESobl 10/07/22		国	債 証 券	0.0000	3,000	3,047	363,736	2022/10/07
BUNDESobl 10/13/23		国	債 証 券	0.0000	4,800	4,910	586,217	2023/10/13
BUNDESSCHAT 0.0 12/10/21		国	債 証 券	0.0000	40	40	4,821	2021/12/10
小 計		—	—	—	178,790	214,538	25,609,478	—
(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	4,579	546,625	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29		国	債 証 券	6.0000	3,500	5,188	619,345	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24		国	債 証 券	4.8000	3,000	3,546	423,372	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37		国	債 証 券	4.2000	4,460	6,776	808,954	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23		国	債 証 券	5.4000	3,740	4,298	513,116	2023/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25		国	債 証 券	1.6000	1,810	1,959	233,941	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24		国	債 証 券	3.8000	5,600	6,469	772,277	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27		国	債 証 券	1.5000	3,700	4,046	483,009	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26		国	債 証 券	1.9500	5,990	6,674	796,750	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28		国	債 証 券	1.4000	2,010	2,192	261,715	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29		国	債 証 券	1.4500	5,320	5,834	696,472	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22		国	債 証 券	0.4000	3,300	3,349	399,782	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30		国	債 証 券	0.5000	2,530	2,549	304,275	2030/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23		国	債 証 券	0.0000	1,860	1,873	223,604	2023/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26		国	債 証 券	5.9000	4,440	6,025	719,210	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40		国	債 証 券	4.9000	2,300	3,920	467,972	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41		国	債 証 券	4.7000	3,800	6,425	767,035	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66		国	債 証 券	3.4500	1,960	3,198	381,792	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25		国	債 証 券	4.6500	4,820	5,985	714,468	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30		国	債 証 券	1.9500	2,620	3,009	359,293	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32		国	債 証 券	5.7500	4,820	7,738	923,731	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33		国	債 証 券	2.3500	3,400	4,109	490,601	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28		国	債 証 券	1.4000	2,460	2,683	320,313	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35		国	債 証 券	1.8500	2,770	3,183	379,995	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24		国	債 証 券	0.2500	2,450	2,493	297,606	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23		国	債 証 券	0.3500	3,300	3,361	401,312	2023/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24		国	債 証 券	2.7500	3,930	4,428	528,640	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28		国	債 証 券	5.1500	4,410	6,173	736,885	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44		国	債 証 券	5.1500	2,440	4,499	537,119	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46		国	債 証 券	2.9000	2,990	4,120	491,878	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48		国	債 証 券	2.7000	3,230	4,334	517,402	2048/10/31

銘	柄	当		利	率	額	面	金	額	期		末			
		種	類							評			価	額	
										外	貨				建
(ユーロ…スペイン)					%				千ユーロ		千ユーロ		千円		
SPAIN 1.0 10/31/50		国	債	証	券	1.0000		690		638		76,221		2050/10/31	
SPAIN 2.15 10/31/25		国	債	証	券	2.1500		4,650		5,196		620,347		2025/10/31	
SPAIN 1.45 10/31/27		国	債	証	券	1.4500		6,450		7,039		840,304		2027/10/31	
SPAIN 0.6 10/31/29		国	債	証	券	0.6000		4,720		4,819		575,252		2029/10/31	
SPAIN 4.4 10/31/23		国	債	証	券	4.4000		4,080		4,721		563,623		2023/10/31	
SPAIN 0.05 10/31/21		国	債	証	券	0.0500		6,080		6,115		729,960		2021/10/31	
SPAIN 0.45 10/31/22		国	債	証	券	0.4500		3,040		3,098		369,864		2022/10/31	
SPAIN 1.25 10/31/30		国	債	証	券	1.2500		2,000		2,151		256,764		2030/10/31	
小計		—			—		138,830		168,809		20,150,842		—		
(ユーロ…イタリア)					%				千ユーロ		千ユーロ		千円		
ITALY BTPS 0.85 01/15/27		国	債	証	券	0.8500		2,000		1,980		236,436		2027/01/15	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23		国	債	証	券	0.0500		3,180		3,166		378,025		2023/01/15	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33		国	債	証	券	5.7500		6,440		9,446		1,127,668		2033/02/01	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37		国	債	証	券	4.0000		4,390		5,683		678,467		2037/02/01	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28		国	債	証	券	2.0000		3,290		3,501		417,950		2028/02/01	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47		国	債	証	券	2.7000		3,340		3,650		435,814		2047/03/01	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48		国	債	証	券	3.4500		2,150		2,665		318,162		2048/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24		国	債	証	券	4.5000		3,500		4,010		478,741		2024/03/01	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67		国	債	証	券	2.8000		1,600		1,725		205,927		2067/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25		国	債	証	券	5.0000		8,750		10,485		1,251,613		2025/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22		国	債	証	券	5.0000		4,810		5,214		622,399		2022/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26		国	債	証	券	4.5000		3,500		4,202		501,646		2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32		国	債	証	券	1.6500		4,320		4,395		524,725		2032/03/01	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40		国	債	証	券	3.1000		2,130		2,495		297,869		2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35		国	債	証	券	3.3500		3,370		4,055		484,065		2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30		国	債	証	券	3.5000		4,660		5,578		665,852		2030/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23		国	債	証	券	0.9500		2,700		2,752		328,583		2023/03/15	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23		国	債	証	券	0.9500		5,000		5,094		608,118		2023/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36		国	債	証	券	1.4500		3,070		2,937		350,634		2036/03/01	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22		国	債	証	券	1.3500		3,000		3,067		366,121		2022/04/15	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22		国	債	証	券	1.2000		2,700		2,753		328,661		2022/04/01	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30		国	債	証	券	1.3500		4,220		4,233		505,404		2030/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31		国	債	証	券	6.0000		4,300		6,247		745,811		2031/05/01	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23		国	債	証	券	4.5000		4,430		4,961		592,239		2023/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24		国	債	証	券	1.8500		2,800		2,940		350,981		2024/05/15	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26		国	債	証	券	1.6000		3,300		3,436		410,229		2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25		国	債	証	券	1.5000		2,550		2,644		315,635		2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27		国	債	証	券	2.2000		2,500		2,693		321,552		2027/06/01	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23		国	債	証	券	0.6000		2,000		2,017		240,840		2023/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26		国	債	証	券	2.1000		90		96		11,478		2026/07/15	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24		国	債	証	券	1.7500		4,140		4,333		517,269		2024/07/01	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22		国	債	証	券	1.0000		3,050		3,104		370,604		2022/07/15	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34		国	債	証	券	5.0000		1,800		2,530		302,101		2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39		国	債	証	券	5.0000		2,660		3,918		467,808		2039/08/01	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23		国	債	証	券	4.7500		2,240		2,544		303,780		2023/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27		国	債	証	券	2.0500		5,700		6,081		725,903		2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29		国	債	証	券	3.0000		4,400		5,061		604,136		2029/08/01	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22		国	債	証	券	0.9000		3,000		3,047		363,803		2022/08/01	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38		国	債	証	券	2.9500		2,130		2,427		289,752		2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44		国	債	証	券	4.7500		2,590		3,815		455,468		2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46		国	債	証	券	3.2500		3,850		4,606		549,932		2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28		国	債	証	券	4.7500		4,840		6,190		738,927		2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40		国	債	証	券	5.0000		2,910		4,297		512,991		2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50		国	債	証	券	2.4500		2,210		2,274		271,537		2050/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33		国	債	証	券	2.4500		3,650		3,998		477,330		2033/09/01	

銘	柄	当			期			末									
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日							
											外	貨	建	金	額	邦	貨
(ユーロ…イタリア)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千	円			
ITALY BTPS 3.75 09/01/24		国	債	証	券	3.7500	6,380			7,204		859,955			2024/09/01		
ITALY BTPS 3.85 09/01/49		国	債	証	券	3.8500	960			1,273		151,983			2049/09/01		
ITALY BTPS 5.5 09/01/22		国	債	証	券	5.5000	2,960			3,306		394,688			2022/09/01		
ITALY BTPS 2.25 09/01/36		国	債	証	券	2.2500	2,400			2,549		304,336			2036/09/01		
ITALY BTPS 1.45 09/15/22		国	債	証	券	1.4500	4,140			4,257		508,196			2022/09/15		
ITALY BTPS 0.65 10/15/23		国	債	証	券	0.6500	1,870			1,888		225,469			2023/10/15		
ITALY BTPS 2.3 10/15/21		国	債	証	券	2.3000	3,300			3,403		406,220			2021/10/15		
ITALY BTPS 2.45 10/01/23		国	債	証	券	2.4500	3,030			3,235		386,212			2023/10/01		
ITALY BTPS 9.0 11/01/23		国	債	証	券	9.0000	1,700			2,188		261,250			2023/11/01		
ITALY BTPS 7.25 11/01/26		国	債	証	券	7.2500	2,150			2,982		356,018			2026/11/01		
ITALY BTPS 6.5 11/01/27		国	債	証	券	6.5000	3,400			4,685		559,272			2027/11/01		
ITALY BTPS 5.25 11/01/29		国	債	証	券	5.2500	2,850			3,839		458,323			2029/11/01		
ITALY BTPS 5.5 11/01/22		国	債	証	券	5.5000	3,200			3,597		429,422			2022/11/01		
ITALY BTPS 1.45 11/15/24		国	債	証	券	1.4500	2,800			2,899		346,135			2024/11/15		
ITALY BTPS 2.5 11/15/25		国	債	証	券	2.5000	3,430			3,732		445,560			2025/11/15		
ITALY BTPS 0.35 11/01/21		国	債	証	券	0.3500	5,800			5,832		696,239			2021/11/01		
ITALY BTPS 2.0 12/01/25		国	債	証	券	2.0000	2,900			3,082		368,007			2025/12/01		
ITALY BTPS 1.25 12/01/26		国	債	証	券	1.2500	3,500			3,565		425,621			2026/12/01		
ITALY BTPS 2.5 12/01/24		国	債	証	券	2.5000	5,290			5,712		681,959			2024/12/01		
ITALY BTPS 2.8 12/01/28		国	債	証	券	2.8000	10,110			11,415		1,362,634			2028/12/01		
ITALY BTPS 2.15 12/15/21		国	債	証	券	2.1500	2,010			2,074		247,673			2021/12/15		
小計		—			—		227,440			259,095		30,928,195			—		
(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	1,200			1,319		157,531			2024/04/15		
FINLAND 0.75 04/15/31		国	債	証	券	0.7500	610			671		80,153			2031/04/15		
FINLAND 1.375 04/15/47		国	債	証	券	1.3750	760			990		118,244			2047/04/15		
FINLAND 0.5 04/15/26		国	債	証	券	0.5000	520			549		65,576			2026/04/15		
FINLAND 1.125 04/15/34		国	債	証	券	1.1250	1,510			1,746		208,530			2034/04/15		
FINLAND 1.5 04/15/23		国	債	証	券	1.5000	890			942		112,523			2023/04/15		
FINLAND 04/15/22		国	債	証	券	0.0000	610			616		73,609			2022/04/15		
FINLAND 0.125 04/15/36		国	債	証	券	0.1250	360			363		43,423			2036/04/15		
FINLAND 4.0 07/04/25		国	債	証	券	4.0000	1,440			1,773		211,659			2025/07/04		
FINLAND 2.75 07/04/28		国	債	証	券	2.7500	1,180			1,474		176,024			2028/07/04		
FINLAND 2.625 07/04/42		国	債	証	券	2.6250	950			1,464		174,859			2042/07/04		
FINLAND 0.5 09/15/29		国	債	証	券	0.5000	880			940		112,286			2029/09/15		
FINLAND 0.875 09/15/25		国	債	証	券	0.8750	780			836		99,867			2025/09/15		
FINLAND 0.5 09/15/28		国	債	証	券	0.5000	300			319		38,193			2028/09/15		
FINLAND 0.5 09/15/27		国	債	証	券	0.5000	1,160			1,232		147,182			2027/09/15		
FINLAND 1.625 09/15/22		国	債	証	券	1.6250	780			819		97,774			2022/09/15		
FINLAND 09/15/23		国	債	証	券	0.0000	470			478		57,169			2023/09/15		
FINLAND 0.0 09/15/24		国	債	証	券	0.0000	350			358		42,754			2024/09/15		
小計		—			—		14,750			16,900		2,017,364			—		
(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	660			1,508		180,026			2062/01/26		
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国	債	証	券	1.5000	1,450			1,898		226,609			2047/02/20		
AUSTRIA 0.5 02/20/29		国	債	証	券	0.5000	2,840			3,026		361,316			2029/02/20		
AUSTRIA 0.75 02/20/28		国	債	証	券	0.7500	1,000			1,082		129,243			2028/02/20		
AUSTRIA 0.0 02/20/30		国	債	証	券	0.0000	440			447		53,469			2030/02/20		
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国	債	証	券	4.8500	1,700			2,225		265,647			2026/03/15		
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国	債	証	券	4.1500	2,420			4,046		482,999			2037/03/15		
AUSTRIA 0.75 03/20/51		国	債	証	券	0.7500	760			847		101,199			2051/03/20		
AUSTRIA 0.5 04/20/27		国	債	証	券	0.5000	2,300			2,440		291,360			2027/04/20		
AUSTRIA 0.0 04/20/23		国	債	証	券	0.0000	1,000			1,016		121,306			2023/04/20		
AUSTRIA 2.4 05/23/34		国	債	証	券	2.4000	1,890			2,516		300,408			2034/05/23		
AUSTRIA 3.15 06/20/44		国	債	証	券	3.1500	980			1,652		197,270			2044/06/20		

銘	柄	当 期				末	
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ…オーストリア)			%	千ユーロ	千ユーロ		千円
AUSTRIA 6.25 07/15/27		国 債 証 券	6.2500	1,160	1,705		203,584
AUSTRIA 07/15/23		国 債 証 券	0.0000	850	864		103,224
AUSTRIA 07/15/24		国 債 証 券	0.0000	2,670	2,729		325,831
AUSTRIA 3.5 09/15/21		国 債 証 券	3.5000	4,840	5,081		606,580
AUSTRIA 2.1 09/20/17		国 債 証 券	2.1000	920	1,791		213,823
AUSTRIA 1.65 10/21/24		国 債 証 券	1.6500	1,990	2,183		260,637
AUSTRIA 0.75 10/20/26		国 債 証 券	0.7500	1,150	1,236		147,585
AUSTRIA 1.2 10/20/25		国 債 証 券	1.2000	1,470	1,604		191,533
AUSTRIA 1.75 10/20/23		国 債 証 券	1.7500	870	938		111,989
AUSTRIA 1.5 11/02/86		国 債 証 券	1.5000	400	594		70,996
AUSTRIA 3.4 11/22/22		国 債 証 券	3.4000	2,460	2,699		322,278
小 計		—	—	36,220	44,139		5,268,925
合 計		—	—	—	—		339,429,470

■投資信託財産の構成

2020年6月22日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円 339,429,470		% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,905,596		2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	348,335,066		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、332,599,241千円、95.5％です。
- (注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝106.77円、1カナダ・ドル＝78.37円、1オーストラリア・ドル＝72.86円、1シンガポール・ドル＝76.38円、1イギリス・ポンド＝131.78円、1イスラエル・シェケル＝30.91円、1デンマーク・クローネ＝16.01円、1ノルウェー・クローネ＝11.05円、1スウェーデン・クローナ＝11.28円、1メキシコ・ペソ＝4.72円、1マレーシア・リンギット＝24.96円、1ポーランド・ズロチ＝26.72円、1ユーロ＝119.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月22日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	701,472,219,144円
コ	ン	4,346,338,416
公	債(評価額)	339,429,470,073
未	収 入	355,602,829,692
未	収 利	1,728,853,325
前	払 費	364,727,638
(B) 負	債	364,138,906,795
未	払 金	364,127,483,795
未	払 解 約	11,423,000
(C) 純	資 産 総 額(A-B)	337,333,312,349
元	本	230,136,350,831
次	期 繰 越 損 益 金	107,196,961,518
(D) 受	益 権 総 口 数	230,136,350,831口
1	万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	14,658円

(注1) 期首元本額 327,518,238,620円
 追加設定元本額 372,741,135,596円
 一部解約元本額 470,123,023,385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>	4,983,783,965円
たわらノーロード バランス (堅実型)	225,731,910円
たわらノーロード バランス (標準型)	539,927,280円
たわらノーロード バランス (積極型)	248,963,737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)	11,596,633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)	467,334,517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)	480,337,957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)	114,574,770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)	16,420,708円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	3,363,911円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	6,566,503円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	12,882,283円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,354,359円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,675,587円
投資のソムリエ	81,297,161,086円
投資のソムリエ<DC年金>	7,880,337,302円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,151,910,141円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	57,262,511,436円
ワールドアセットバランス (基本コース)	3,425,326,635円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	2,310,540,584円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	64,579,720円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	37,901,657円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	59,725,579円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	142,207,741円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	24,972,939,068円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,121,493,462円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	18,373,264円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	7,480,327円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	8,102,360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)	19,976,339,042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)	5,943,085,380円
D I AM世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	530,035,974円

D I AM世界アセットバランスファンド40 V A (適格機関投資家限定) 60,913,162円
 D I AM世界アセットバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定) 428,836,613円
 D I AM世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定) 966,109,573円
 D I AM世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定) 1,102,111,668円
 D I AMバランス20 V A (適格機関投資家限定) 17,897,159円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1212) (適格機関投資家限定) 2,045,914,615円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1303) (適格機関投資家限定) 2,183,735,880円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1306) (適格機関投資家限定) 2,887,293,805円
 D I AM世界アセットバランスファンド7 V A (1309) (適格機関投資家限定) 115,973,478円
 期末元本合計 230,136,350,831円

■損益の状況

当期 自2019年6月25日 至2020年6月22日

項	目	当	期
(A) 配	当	等	収
受	取	利	益
そ	の	他	収
支	払	利	益
(B) 有	価	証	券
売		売	買
売		買	損
(C) そ	の	他	費
(D) 当	期	損	益
(E) 前	期	繰	越
(F) 解	約	差	損
(G) 追	加	信	託
(H) 合			計
次	期	繰	越
			損
			益
			金(H)
			9,339,834,419円
			9,344,843,727
			70,369
			△5,079,677
			15,747,720,457
			72,957,092,108
			△57,209,371,651
			△43,341,345
			25,044,213,531
			127,340,088,329
			△205,679,366,746
			160,492,026,404
			107,196,961,518
			107,196,961,518

(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13期（決算日 2020年6月22日）

（対象期間 2019年6月25日～2020年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		S & P 先進国 R E I T インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投 資 信 託 受益証券、 投 資 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額 総
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率		
	円	%	ポイント	%	%	百万円
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
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753

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

（注2）S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I Tインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

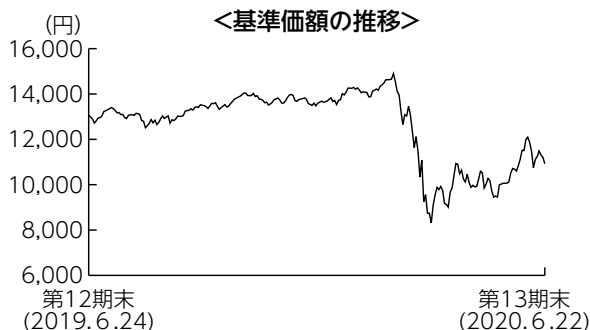
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率	
(期 首) 2019 年 6 月 24 日	円 13,060	% －	ポイント 131,885.51	% －	% 99.2
6 月 末	12,817	△1.9	129,636.53	△1.7	99.3
7 月 末	13,137	0.6	132,945.01	0.8	99.5
8 月 末	13,026	△0.3	132,025.50	0.1	99.3
9 月 末	13,574	3.9	137,663.18	4.4	99.7
10 月 末	14,027	7.4	142,261.33	7.9	99.6
11 月 末	13,981	7.1	141,938.55	7.6	99.5
12 月 末	13,831	5.9	140,439.63	6.5	99.8
2020 年 1 月 末	14,072	7.7	143,073.05	8.5	99.4
2 月 末	13,225	1.3	134,573.20	2.0	99.3
3 月 末	9,920	△24.0	100,830.59	△23.5	108.2
4 月 末	10,594	△18.9	107,670.68	△18.4	99.4
5 月 末	10,687	△18.2	108,781.24	△17.5	98.9
(期 末) 2020 年 6 月 22 日	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2019年6月25日から2020年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,922円となり、前期末比で16.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は2020年2月までは堅調に推移しましたが、新型コロナウイルスの影響からほとんどの外国リート市場が下落したに加え、為替市場においても多くの通貨が対円で下落し円高となったことから、当ファンドの基準価額は下落しました。

投資環境

外国リート市場は米国の堅調な企業業績や長期金利の低下などに加え、欧州の低金利環境の長期化期待などを背景に堅調に推移しました。しかしながら2020年2月下旬以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大の影響から、景気悪化懸念が広がり大きく下落しました。3月下旬以降は反発局面となり、ワクチン開発や経済活動再開への期待などから値を戻しましたが、前期末比では下落して期末を迎えました。

為替市場では、米国の緊急利下げを受けた米長期金利の低下や、新型コロナウイルスの感染拡大や原油価

格の急落を背景としたリスク回避姿勢の強まりなどから、2020年2月後半から3月にかけて急速に円高米ドル安が進行しました。その後は世界的な米ドル資金需要の高まりなどから円安米ドル高に転じたものの、米中関係悪化への警戒感や経済活動の再開期待などの材料が交錯し、方向感のない展開となりました。ユーロやオーストラリアドルは対円で下落しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである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15.7%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%下回りました。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	4円	0.029%
(株 式)	(0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	(1)	(0.004)
(投 資 証 券)	(3)	(0.025)
(b) 有価証券取引税	11	0.089
(株 式)	(0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	(1)	(0.007)
(投 資 証 券)	(10)	(0.082)
(c) そ の 他 費 用	11	0.089
(保 管 費 用)	(8)	(0.065)
(そ の 他)	(3)	(0.023)
合 計	26	0.206

(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(12,607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6月25日から2020年6月22日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 — (54.72)	千アメリカ・ドル — (23)	百株 54.72	千アメリカ・ドル 23
	カ ナ ダ	百株 375.48 (△300.48)	千カナダ・ドル 778 (△622)	百株 75	千カナダ・ドル 150
	イ ギ リ ス	百株 1,617.4 (△1,617.4)	千イギリス・ポンド 272 (△272)	百株 —	千イギリス・ポンド —

(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		売	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	73.928	11,463	76.572	11,808
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	1.125	358	1.873	627
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	86.436	10,458	98.391	12,783
	(-)	(-)	(-)	(-)
CEDAR REALTY TRUST INC	-	-	13.618	28
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	131.917	4,969	139.652	5,500
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	88.054	4,207	95.639	4,844
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	29.369	2,060	26.556	1,922
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	2.662	23	1.643	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	49.19	3,623	56.479	4,490
	(-)	(-)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	45.41	2,713	49.043	3,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	408.022	36,004	440.532	37,743
	(29.908)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	83.024	16,378	90.526	18,837
	(-)	(-)	(-)	(-)
LEXINGTON REALTY TRUST	162.849	1,717	157.874	1,643
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	57.666	5,939	63.038	6,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES	23.633	35	56.01	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
MACK CALI	49.145	971	53.629	1,130
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	70.773	42,253	44.549	26,556
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	100.587	4,881	106.58	5,673
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	88.188	3,112	96.175	3,535
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12.153	228	13.988	292
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	84.8	987	89.542	1,180
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	218.861	7,514	236.704	7,988
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	-	16.616	16
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	39.249	11,570	43.183	13,034
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
EQUITY RESIDENTIAL	210.388	16,421	237.678	19,153
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42.161	4,821	47.542	5,932
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	76.565	3,005	83.109	3,281
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	306.271	9,782	316.293	10,581
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	72	2,376	78.964	2,535
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	82.569	2,690	86.449	2,936
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	61.61	2,662	66.887	3,049
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	96.829	1,819	104.784	2,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	250.339	18,654	263.961	20,978
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	22.447	2,763	23.745	2,991
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	250.151	4,212	273.213	5,095
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	61.466	4,563	65.772	5,075
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	21.849	958	24.506	1,130
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	119.252	781	129.607	945
	(-)	(△20)	(-)	(-)
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	55.618	766	60.721	856
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIBERTY PROPERTY TRUST	46.169	2,455	54.232	2,981
	(△44.309)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	100.925	1,368	113.101	1,614
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	169.513	5,100	185.077	5,762
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	63.048	1,331	66.591	1,646
	(1.071)	(7)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	87.478	7,192	98.056	8,140
	(32.371)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	47.569	1,067	51.181	1,271
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	434.49	6,517	488.254	7,647
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	67.88	8,583	74.2	9,722
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.498	79	10.813	130
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	25.284	1,861	27.542	2,205
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	5.235	354	6.222	434
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6.257	134	5.415	133
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12.862	72	22.034	66
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	19.05	567	21.286	640
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	11.546	1,867	12.745	2,099
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	40.466	433	42.706	549
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	202.236	13,940	208.241	15,454
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	98.518	5,651	107.912	6,701
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	173.701	7,815	184.094	8,613
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	65.084	1,825	71.223	1,979
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORECIVIC INC	65.815	976	71.543	1,121
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	4.939	208	5.572	250
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	184.467	21,981	202.343	27,263
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	28.387	2,908	30.792	3,293
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	89.863	20,060	97.998	22,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	57.468	8,396	58.908	9,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
TAUBMAN CENTERS INC	35.202	1,335	38.855	1,648
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER FACTORY OUTLET	52.498	635	56.596	759
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	14.648	202	16.547	225
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14.099	275	14.855	294
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7.254	781	8.149	874
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	223.063	12,254	238.823	14,008
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	94.048	5,277	108.239	6,403
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON REIT	44.537	1,197	48.263	1,354
	(-)	(-)	(-)	(-)
GEO GROUP INC	63.788	953	69.573	1,086
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
WEINGARTEN REALTY INVST	68.934	1,737	75.901	2,131
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	83.828	3,572	91.849	4,183
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	47.055	679	52.461	859
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	77.018	8,245	83.912	9,070
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53.217	380	60.653	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	131.125	1,569	146.164	1,789
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	115.577	3,589	124.502	4,001
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	144.286	19,233	138.559	17,511
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	109.905	938	123.184	1,171
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	339.568	6,534	319.53	6,489
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	98.615	3,793	107.284	4,359
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	64.15	963	70.93	1,190
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	71.787	1,444	79.357	1,672
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	59.549	579	67.1	700
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	39.84	2,132	41.774	2,256
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	29.638	1,233	28.36	1,248
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	98.079	1,396	111.376	1,675
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	120.456	4,221	126.131	4,299
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	23.102	2,726	24.083	2,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	642.088	5,345	665.444	6,002
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHESAPEAKE LODGING TRUST	5.02	130	5.642	149
	(△20.497)	(△574)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	74.195	1,611	82.327	1,895
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	27.891	825	31.223	937
	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	19.153	197	20.73	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	20.564	260	22.718	345
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
SABRA HEALTH CARE REIT INC	115.26	2,185	118.283	2,366
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	14.96	136	16.906	197
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	92.814	2,918	102.019	3,404
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	86.007	2,504	84.975	2,482
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	120.216	1,234	130.353	1,532
	(-)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	70.15	4,834	74.521	4,859
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	102.444	8,117	111.607	9,235
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	10.297	127	8.362	106
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	125.796	3,576	133.349	4,016
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31.694	2,185	33.407	2,477
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	16.642	162	19.626	239
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	60.133	2,601	59.794	2,796
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	114.489	1,978	118.435	2,188
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	70.252	3,102	70.443	3,196
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	155.05	3,982	171.244	4,502
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	54.571	705	62.027	848
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10.051	892	8.231	754
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	68.855	2,575	76.522	2,916
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN FINANCE TRUST INC	71.133	840	59.164	703
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL VALUE INC	4.797	98	5.928	171
	(0.219)	(8)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	324.214	9,091	298.944	8,676
	(-)	(-)	(-)	(-)
QTS REALTY TRUST INC	32.393	1,830	33.783	1,836
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT MTA REIT	5.315	44	19.261	165
	(-)	(-)	(-)	(-)
COREPOINT LODGING INC	23.965	187	10.317	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	83.944	1,023	87.762	1,139
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10.935	173	5.949	111
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	5.165	237	3.864	204
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	57.385	1,220	48.583	1,142
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	38.581	795	43.195	918
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	64.89	1,203	70.656	1,419
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	119.231	4,464	130.086	5,367
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	176.843	3,060	193.665	3,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.355	66	10.956	85
	(-)	(△1)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	40.737	679	57.267	1,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAGLE HOSPITALITY TRUST	150	84	77.3	20
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	210.2	185	66.6	60
	(-)	(△2)	(-)	(-)
ARA US HOSPITALITY TRUST	420.6	325	265.5	192
	(-)	(△2)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	9.686	92	8.093	93
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	5.098	33	5.35	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	27.435	332	29.462	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON PRIME GROUP INC	85.115	164	106.134	272
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	52.315	1,092	56.662	1,215
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34.332	168	38.372	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	128.373	4,103	133.097	4,656
	(-)	(-)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	113.279	1,360	128.052	1,605
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18.432	212	13.579	167
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	69.162	1,110	81.192	1,411
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	45.835	1,074	49.803	1,119
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	60.338	1,011	65.713	1,217
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	12.327	511	13.436	607
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	33.855 (-)	1,092 (-)	35.758 (-)	1,204 (-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9.933 (-)	414 (-)	10.503 (-)	475 (-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	123.934 (-)	1,687 (-)	138.502 (-)	1,972 (-)
GLOBAL NET LEASE INC	49.415 (-)	888 (-)	51.627 (-)	1,002 (-)
CLIPPER REALTY INC	3.147 (-)	22 (-)	3.23 (-)	32 (-)
MANULIFE US REIT	114.5 (△449.5)	102 (△393)	121.5 (-)	107 (-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	761.4 (449.5)	672 (383)	788.8 (-)	743 (-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	137.59 (12.872)	2,612 (348)	151.963 (-)	3,193 (-)
VICI PROPERTIES INC	295.273 (-)	6,403 (-)	285.103 (-)	6,622 (-)
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	6.014 (-)	101 (-)	24.82 (-)	420 (-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	19.507 (-)	578 (-)	20.409 (-)	713 (-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	35.694 (-)	937 (-)	40.109 (-)	1,126 (-)
COLONY CAPITAL INC	276.179 (-)	1,148 (-)	308.566 (-)	1,449 (-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	41.118 (-)	1,177 (-)	45.221 (-)	1,372 (-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	52.243 (-)	2,738 (-)	53.754 (-)	2,931 (-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	84.732 (-)	1,575 (-)	93.683 (-)	1,946 (-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32.471 (30.048)	544 (622)	31.886 (-)	627 (-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	96.764 (-)	2,249 (-)	102.119 (-)	2,614 (-)
ALLIED PROPERTIES REIT	38.369 (-)	1,927 (-)	38.662 (-)	2,039 (-)
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	51.333 (-)	617 (-)	56.914 (-)	764 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	15.515 (-)	420 (-)	16.705 (-)	508 (-)
NORTHVIEW APARTMENT REIT	17.344 (-)	545 (-)	17.87 (-)	574 (-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	12.786 (-)	499 (-)	13.427 (-)	593 (-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37.078 (-)	401 (-)	40.38 (-)	479 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CROMBIE REAL ESTATE INV	26.105	387	29.181	448
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	27.588	419	29.178	471
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	35.868	396	33.636	402
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8.897	149	9.591	174
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25.26	396	58.463	954
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	39.38	480	39.241	495
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	36.49	432	34.91	447
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.585	1,159	17.619	1,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	11.698	70	9.749	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	93.762	1,288	101.024	1,409
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.847	169	7.887	184
	(-)	(-)	(-)	(-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40.371	590	42.796	654
	(-)	(-)	(-)	(-)
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.087	225	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE RETAIL REIT	5.598	58	6.381	74
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE OFFICE REIT	6.435	23	6.88	35
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REIT	6.05	121	7.516	145
	(△15.493)	(△307)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19.793	374	20.546	438
	(15.493)	(307)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	286.22	1,113	307.178	1,181
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	2,373.635	6,906	2,590.245	7,912
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,191.976	1,333	1,230.516	1,457
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	242.282	963	229.703	1,035
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	1,201.177	6,599	1,257.962	7,326
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS PROPERTY GROUP	210.096	727	230.504	854
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	133.624	439	154.426	529
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
STOCKLAND	1,446.562	5,979	1,590.502	7,261
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	147.777	629	158.63	698
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	642.111	7,320	703.535	8,514
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	953.521	13,802	1,043.133	15,059
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	2,118.974	4,559	2,052.978	4,819
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	269.701	2,896	295.348	3,382
	(-)	(-)	(-)	(-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	141.38	541	154.672	648
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	593.154	1,529	605.195	1,654
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	150.041	403	163.478	472
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	279.783	1,483	234.247	1,266
	(-)	(-)	(-)	(-)
APN INDUSTRIA REIT	32.553	84	29.56	86
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	563.797	1,024	526.863	1,035
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	48.855	140	50.458	153
	(-)	(-)	(-)	(-)
GDI PROPERTY GROUP	226.812	299	249.062	346
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	94.329	187	98.245	182
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	3,205.005	10,699	3,549.062	12,695
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA OFFICE REIT	258.952	709	143.044	413
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAYPOINT REIT LTD	322.804	863	270.487	730
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	1,237.6	98,099	1,378.1	109,460
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROSPERITY REIT	344	927	445	1,312
	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	899	4,286	932	4,651
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	1,089	5,286	1,178	5,671
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	550	2,639	621	3,055
	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	129	1,235	131	1,302
	(△475)	(△4,929)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	716 (475)	6,026 (4,929)	786 (-)	6,663 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND MALL TRUST	1,753.8 (-)	4,109 (-)	1,916 (-)	4,685 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,826 (-)	5,580 (△16)	1,856.1 (-)	5,719 (-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,703.1 (-)	3,250 (-)	1,854.5 (-)	3,660 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,351.5 (-)	2,308 (△5)	1,461.3 (-)	2,608 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,892.9 (-)	3,268 (△17)	1,852.5 (-)	3,221 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	716.6 (-)	464 (△1)	811.6 (-)	556 (-)
ASCOTT TRUST	878.7 (202.601)	991 (241)	989.9 (-)	1,201 (-)
FRASERS COMMERCIAL TRUST	252.1 (△113.88)	401 (△176)	382.5 (-)	617 (-)
KEPPEL REIT	1,127.8 (-)	1,330 (-)	1,200.6 (-)	1,462 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	427.1 (-)	1,101 (-)	448.9 (-)	1,242 (-)
ESR REIT	1,049.5 (-)	490 (-)	1,073.3 (-)	559 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	482.4 (-)	673 (△4)	489.1 (-)	732 (-)
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	480.4 (-)	719 (△23)	481.2 (-)	715 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	257.9 (-)	236 (△5)	276.3 (-)	271 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	256.4 (-)	345 (△0.16673)	333.5 (-)	472 (-)
PARKWAY LIFE REIT	225 (-)	740 (△2)	237.3 (-)	782 (-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	1,036.3 (-)	200 (△3)	993.1 (-)	205 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	914.4 (-)	2,330 (△0.5021)	919.5 (-)	2,390 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,334.4 (-)	2,897 (△0.17955)	1,347 (-)	2,995 (-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	545.7 (-)	356 (△0.47411)	645.7 (-)	456 (-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	261.4 (-)	93 (-)	193.8 (-)	79 (-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,243.8 (-)	1,424 (△18)	1,371.3 (-)	1,611 (-)
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	177.1 (△255.1)	196 (△267)	205.5 (-)	218 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	329.7	198	414	267
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPH REIT	499.1	504	487	504
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUE HOSPITALITY TRUST	150.8	111	189.1	136
	(△407.02)	(△292)	(-)	(-)
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	431.4	196	412.8	196
	(-)	(△0.57467)	(-)	(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	285.6	219	120.4	86
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUE COMMERCIAL REIT	1,528.2	766	1,308	662
	(552.855)	(275)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	-	-	180.153	44
	(180.153)	(-)	(-)	(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	203.6	154	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST	259.7	146	297	185
	(-)	(△3)	(-)	(-)
KEPPEL DC REIT	774	1,630	755.3	1,590
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,000.2	1,155	973.1	1,179
	(140.414)	(143)	(-)	(-)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	606.07	1,072	660.09	1,197
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	180.938	478	202.203	544
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	696.471	1,554	729.346	1,608
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	945.872	1,350	1,011.417	1,523
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	353.866	458	389.63	533
	(-)	(-)	(-)	(-)
STRIDE STAPLED GROUP	19.128	43	159.167	355
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	581.439	2,973	641.453	3,341
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & REGIONAL PLC	87.954	23	13.153	24
	(△201.052)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	64.624	2,236	71.761	2,570
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	90.236	975	96.492	1,038
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	455.24	890	490.897	1,127
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	448.997	3,646	492.772	4,169
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	73.453	709	81.28	834
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
INTU PROPERTIES PLC	310.357	66	375.192	61
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	234.956	2,524	220.181	2,474
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	725.379	1,072	765.285	1,112
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	128.672	1,042	145.441	1,212
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	661.393	5,495	713.476	5,864
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	157.747	1,203	180.18	1,413
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	1,528.598	1,159	1,594.973	1,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	267.456	124	284.604	146
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	305.274	262	329.103	307
	(-)	(-)	(-)	(-)
HANSTEEN HOLDINGS PLC	32.232	32	191.752	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	498.504	395	472.016	389
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	112.923	807	124.65	916
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	550.58	1,165	532.902	1,139
	(-)	(-)	(-)	(-)
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	245.021	180	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	100.236	161	14.755	24
	(161.74)	(272)	(-)	(-)
RDI REIT PLC	179.149	180	182.739	202
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	147.258	207	149.119	252
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	363.906	337	409.495	369
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	156.793	150	181.712	161
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,059.763	1,474	1,146.109	1,612
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	364.694	321	373.846	345
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK REIT PLC	89.918	75	34.985	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	335.663	412	309.934	401
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	206.341	202	187.489	205
	(-)	(-)	(-)	(-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シェケル	千□	千イスラエル・シェケル
REIT 1 LTD	69.888	1,368	80.992	1,633
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	14.293	103,068	12.715	89,958
	(-)	(-)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD	25.4	147,692	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	-	-	0.498	-
	(0.498)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GREEN REIT PLC	200.004	383	440.882	832
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIBERNIA REIT PLC	367.834	482	401.87	536
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	212.059	323	216.537	328
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	24.25	489	26.896	590
	(-)	(-)	(-)	(-)
VASTNED RETAIL	8.882	199	9.359	229
	(-)	(-)	(-)	(-)
WERELDHAVE NV	19.966	310	22.281	389
	(-)	(-)	(-)	(-)
NSI NV	10.018	408	11.223	480
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	82.413	8,735	90.038	10,588
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	12.458	627	13.469	711
	(-)	(-)	(-)	(-)
COFINIMMO SA	15.552	2,008	15.714	2,124
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	5.685	414	5.106	392
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10.054	249	11.582	290
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	43.454	1,841	49.972	1,968
	(38.346)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	5.817	475	6.12	504
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	15.551	1,616	16.25	1,758
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	31.965	4,590	34.578	5,303
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	18.205	1,504	26.241	2,225
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALTAREA	1.6	256	1.832	323
	(-)	(△11)	(-)	(-)
KLEPIERRE	121.602	3,220	131.978	3,714
	(-)	(-)	(-)	(-)
COVIVIO	30.245	2,631	37.874	3,592
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ（フランス）	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
MERCIALYS	12.191 (-)	125 (-)	23.432 (-)	260 (-)
ユーロ（ドイツ）	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	31.584 (-)	288 (-)	37.824 (-)	354 (-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	93.039 (-)	1,455 (-)	102.696 (-)	1,670 (-)
ユーロ（スペイン）	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	135.278 (-)	1,405 (△12)	160.831 (-)	1,774 (-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	31.102 (-)	179 (-)	37.651 (-)	243 (-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	220.375 (-)	2,462 (-)	238.884 (-)	2,875 (-)
ユーロ（イタリア）	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20.407 (-)	101 (-)	21.987 (-)	118 (-)

(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。

■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	115,477千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	229千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	502.71

(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6月25日から2020年6月22日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期 首(前期末)		当 期		末	
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
不動産ファンド (アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
EAGLE HOSPITALITY TRUST		—	72.7	9	1,063		0.0
PRIME US REIT		—	143.6	114	12,265		0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST		—	155.1	65	6,955		0.0
MANULIFE US REIT		456.5	—	—	—		—
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		—	422.1	320	34,251		0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40.032		37.388	6,200	662,019		1.9
ALEXANDER'S INC.	1.406		0.658	169	18,074		0.1
BOSTON PROPERTIES INC	54.797		42.842	3,888	415,158		1.2
CEDAR REALTY TRUST INC	27.397		13.779	13	1,485		0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	74.959		67.224	1,987	212,167		0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	52.06		44.475	1,696	181,158		0.5
AGREE REALTY CORP	13.141		15.954	1,076	114,946		0.3
BRT APARTMENTS CORP	2.813		3.832	40	4,361		0.0
SL GREEN	29.965		22.676	1,176	125,583		0.4
EPR PROPERTIES	26.376		22.743	834	89,068		0.3
PROLOGIS INC	221.421		218.819	20,102	2,146,386		6.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	49.184		41.682	6,464	690,210		2.0
LEXINGTON REALTY TRUST	76.871		81.846	873	93,241		0.3
CAMDEN PROPERTY TRUST	34.249		28.877	2,700	288,309		0.8
CBL & ASSOCIATES	47.062		14.685	4	464		0.0
MACK CALI	31.711		27.227	428	45,756		0.1
EQUINIX INC	—		26.224	18,656	1,991,958		5.7
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	57.252		51.259	1,837	196,149		0.6
COUSINS PROPERTIES INC	51.859		43.872	1,348	143,992		0.4
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11.393		9.558	114	12,235		0.0
SITE CENTERS CORP	50.198		45.456	343	36,691		0.1
DUKE REALTY TRUST	127.358		109.515	3,898	416,267		1.2
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25.699		9.083	7	814		0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23.315		19.381	4,530	483,763		1.4
EQUITY RESIDENTIAL	130.924		103.634	6,174	659,252		1.9
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26.353		20.972	1,777	189,770		0.5
FIRST INDUSTRIAL RT	44.501		37.957	1,449	154,771		0.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	169.495		159.473	4,197	448,148		1.3
EQUITY COMMONWEALTH	42.702		35.738	1,127	120,424		0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	44.016		40.136	1,221	130,445		0.4
HIGHWOODS PROPERTIES INC	36.411		31.134	1,201	128,313		0.4
SERVICE PROPERTIES TRUST	57.784		49.829	423	45,168		0.1
WELLTOWER INC	137.308		123.686	6,307	673,503		1.9
EAST GROUP	12.816		11.518	1,353	144,560		0.4
KIMCO REALTY	149.202		126.14	1,604	171,312		0.5
KILROY REALTY CORP	35.671		31.365	1,961	209,403		0.6
LTC PROPERTIES INC	14.61		11.953	451	48,164		0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	83.031		72.676	287	30,689		0.1
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	34.32		29.217	423	45,201		0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	52.372		—	—	—		—
BRANDYWINE REALTY TRUST	61.895		49.719	515	54,996		0.2
IRON MOUNTAIN INC	101.232		85.668	2,256	240,925		0.7
THE MACERICH COMPANY	37.186		34.714	307	32,801		0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32.042		53.835	3,460	369,479		1.1
ACADIA REALTY TRUST	28.451		24.839	330	35,245		0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	262.621		208.857	2,437	260,237		0.7
MID AMERICA	40.303		33.983	3,897	416,100		1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13.759		12.444	77	8,277		0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	14.991		12.733	763	81,474		0.2
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4.546		3.559	250	26,770		0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4.255		5.097	87	9,327		0.0

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17.505	8.333	11	1,210	0.0	
GETTY REALTY CORP	12.616	10.38	314	33,602	0.1	
PS BUSINESS PARKS	7.004	5.805	765	81,702	0.2	
RPT REALTY	27.63	25.39	170	18,190	0.1	
REALTY INCOME CORP	107.748	101.743	6,260	668,406	1.9	
REGENCY CENTERS CORP	59.384	49.99	2,231	238,236	0.7	
UDR INC	97.737	87.344	3,298	352,139	1.0	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	38.643	32.504	824	88,010	0.3	
CORECIVIC INC	41.521	35.793	352	37,604	0.1	
SAUL CENTERS INC	4.421	3.788	123	13,140	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	108.459	90.583	6,079	649,154	1.9	
LIFE STORAGE INC	16.395	13.99	1,314	140,379	0.4	
PUBLIC STORAGE	52.671	44.536	8,488	906,276	2.6	
SUN COMMUNITIES INC	30.554	29.114	4,144	442,526	1.3	
TAUBMAN CENTERS INC	21.393	17.74	661	70,668	0.2	
TANGER FACTORY OUTLET	32.737	28.639	205	21,924	0.1	
UMH PROPERTIES INC	13.433	11.534	146	15,615	0.0	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11.234	10.478	194	20,758	0.1	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4.708	3.813	324	34,677	0.1	
VENTAS INC	126.445	110.685	3,962	423,078	1.2	
VORNADO REALTY TRUST	61.491	47.3	1,851	197,716	0.6	
WASHINGTON REIT	27.867	24.141	524	55,958	0.2	
GEO GROUP INC	42.24	36.455	431	46,045	0.1	
WEINGARTEN REALTY INVST	41.968	35.001	647	69,172	0.2	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	49.096	41.075	1,504	160,643	0.5	
KITE REALTY GROUP TRUST	31.031	25.625	290	31,026	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	45.051	38.157	3,547	378,761	1.1	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	40.56	33.124	156	16,728	0.0	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80.002	64.963	564	60,274	0.2	
CUBESMART	66.756	57.831	1,556	166,158	0.5	
DIGITAL REALTY TRUST INC	73.766	79.493	11,117	1,186,972	3.4	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	73.922	60.643	343	36,647	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	136.49	156.528	3,013	321,715	0.9	
DOUGLAS EMMETT INC	57.933	49.264	1,489	159,007	0.5	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	41.878	35.098	390	41,727	0.1	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	43.929	36.359	604	64,558	0.2	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38.836	31.285	190	20,342	0.1	
TERRENO REALTY CORP	21.401	19.467	1,048	111,905	0.3	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13.155	14.433	408	43,579	0.1	
RLJ LODGING TRUST	61.408	48.111	465	49,672	0.1	
AMERICOLD REALTY TRUST	65.012	59.337	2,139	228,454	0.7	
CORESITE REALTY CORP	12.902	11.921	1,448	154,633	0.4	
VEREIT INC	342.119	318.763	2,161	230,752	0.7	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	21.119	—	—	—	—	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	45.82	37.688	511	54,604	0.2	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17.851	14.519	392	41,932	0.1	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES	16.36	14.783	110	11,806	0.0	
CHATHAM LODGING TRUST	17.398	15.244	95	10,237	0.0	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	62.571	59.548	861	91,935	0.3	
WHITESTONE REIT	15.361	13.415	92	9,854	0.0	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	54.303	45.098	1,137	121,437	0.3	
STAG INDUSTRIAL INC	43.588	44.62	1,298	138,634	0.4	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	74.671	64.534	417	44,580	0.1	
CYRUSONE INC	38.14	33.769	2,588	276,416	0.8	
WP CAREY INC	60.124	50.961	3,514	375,218	1.1	
GLADSTONE LAND CORP	4.129	6.064	92	9,860	0.0	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	72.282	64.729	1,764	188,397	0.5	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18.038	16.325	574	61,319	0.2	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	18.755	15.771	136	14,565	0.0	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	30.159	30.498	1,089	116,346	0.3	

銘柄	期首(前期末)		当		期		末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率		
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%		
PHYSICIANS REALTY TRUST	63.958	60.012	1,070	114,245		0.3		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	36.539	36.348	1,489	159,077		0.5		
AMERICAN HOMES 4 RENT	92.275	76.081	2,048	218,675		0.6		
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	33.291	25.835	284	30,370		0.1		
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	3.694	5.514	527	56,312		0.2		
JBG SMITH PROPERTIES	41.967	34.3	1,038	110,891		0.3		
AMERICAN FINANCE TRUST INC	20.602	32.571	273	29,177		0.1		
RETAIL VALUE INC	5.916	5.004	63	6,731		0.0		
INVITATION HOMES INC	135.096	160.366	4,464	476,684		1.4		
QTS REALTY TRUST INC	19.246	17.856	1,126	120,261		0.3		
SPIRIT MTA REIT	13.946	—	—	—		—		
COREPOINT LODGING INC	—	13.648	55	5,887		0.0		
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	48.864	45.046	308	32,945		0.1		
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	—	4.986	68	7,277		0.0		
SAFEHOLD INC	2.744	4.045	261	27,891		0.1		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	17.735	26.537	453	48,422		0.1		
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	24.28	19.666	404	43,149		0.1		
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	40.874	35.108	478	51,091		0.1		
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	71.712	60.857	2,312	246,912		0.7		
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	105.086	88.264	1,117	119,307		0.3		
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8.936	5.335	17	1,885		0.0		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	33.378	16.848	184	19,661		0.1		
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	6.509	8.102	64	6,903		0.0		
FARMLAND PARTNERS INC	9.63	9.378	61	6,608		0.0		
CITY OFFICE REIT INC	15.324	13.297	132	14,140		0.0		
WASHINGTON PRIME GROUP INC	70.292	49.273	49	5,260		0.0		
CARETRUST REIT INC	33.024	28.677	522	55,786		0.2		
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	31.63	27.59	103	11,076		0.0		
STORE CAPITAL CORP	70.644	65.92	1,615	172,437		0.5		
PARAMOUNT GROUP INC	70.246	55.473	436	46,553		0.1		
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.336	12.189	147	15,708		0.0		
URBAN EDGE PROPERTIES	44.064	32.034	340	36,357		0.1		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	25.372	21.404	502	53,704		0.2		
XENIA HOTELS & RESORTS INC	39.522	34.147	326	34,891		0.1		
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8.002	6.893	240	25,641		0.1		
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	19.694	17.791	502	53,700		0.2		
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.76	6.19	268	28,709		0.1		
APPLE HOSPITALITY REIT INC	75.452	60.884	610	65,135		0.2		
GLOBAL NET LEASE INC	29.176	26.964	449	48,020		0.1		
CLIPPER REALTY INC	5.169	5.086	36	3,850		0.0		
PARK HOTELS & RESORTS INC	70.84	69.339	742	79,289		0.2		
VICI PROPERTIES INC	127.279	137.449	3,089	329,903		0.9		
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	18.806	—	—	—		—		
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10.32	9.418	112	12,006		0.0		
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25.108	20.693	490	52,406		0.2		
COLONY CAPITAL INC	171.468	139.081	368	39,351		0.1		
小計	□数	7,983.341	7,409.052	242,959	25,940,780	—		
銘柄	数<比率>	155銘柄<72.3%>	157銘柄<74.6%>	—	—	74.6		
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%		
SMARTCENTRES REIT	24.167	20.064	416	32,643		0.1		
CANADIAN APT PTYYS REIT	26.047	24.536	1,222	95,798		0.3		
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	48.916	39.965	401	31,445		0.1		
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	—	30.633	440	34,498		0.1		
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	52.282	46.927	740	58,070		0.2		
ALLIED PROPERTIES REIT	18.469	18.176	744	58,374		0.2		
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	30.322	24.741	197	15,511		0.0		
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	9.817	8.627	172	13,535		0.0		
NORTHVIEW APARTMENT REIT	10.523	9.997	344	26,990		0.1		
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.736	7.095	202	15,863		0.0		
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	24.488	21.186	163	12,834		0.0		

銘柄	期首(前期末)	当期				比率
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
CROMBIE REAL ESTATE INV	16.86	13,784	178	14,021	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19.862	18,272	265	20,820	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	22.017	24,249	256	20,125	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	6.696	6,002	89	6,994	0.0	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTM	33.203	—	—	—	—	
DREAM INDUSTRIAL REIT	22.37	22,509	237	18,575	0.1	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	19.293	20,873	229	17,993	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	8.529	8,495	569	44,665	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10.465	12,414	70	5,545	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	53.304	46,042	594	46,619	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	5.037	4,997	103	8,122	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16.489	14,064	193	15,144	0.0	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	—	12,087	221	17,334	0.0	
SLATE RETAIL REIT	6.406	5,623	57	4,494	0.0	
SLATE OFFICE REIT	12.079	11,634	43	3,446	0.0	
KILLAM APARTMENT REIT	16.959	—	—	—	—	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	—	14,74	257	20,215	0.1	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	522.336 25銘柄<1.9%>	487.732 26銘柄<1.9%>	8,417 —	659,685 —	— 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	166.921	145,963	575	41,901	0.1	
MIRVAC GROUP	1,398.222	1,181,612	2,764	201,455	0.6	
CROMWELL PROPERTY GROUP	608.982	570,442	510	37,198	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	124.412	136,991	489	35,632	0.1	
GPT GROUP	632.592	575,807	2,573	187,531	0.5	
ABACUS PROPERTY GROUP	120.666	100,258	278	20,307	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	95.978	75,176	196	14,295	0.0	
STOCKLAND	871.018	727,078	2,632	191,769	0.6	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	79.545	68,692	321	23,422	0.1	
DEXUS	383.348	321,924	3,235	235,726	0.7	
GOODMAN GROUP	568.14	478,528	7,297	531,699	1.5	
VICINITY CENTRES	1,131.404	1,197.4	1,814	132,172	0.4	
CHARTER HALL GROUP	162.348	136,701	1,380	100,596	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	99.748	86,456	290	21,165	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	313.615	301,574	714	52,075	0.1	
ARENA REIT	106.906	93,469	220	16,071	0.0	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	77.55	123,086	568	41,432	0.1	
APN INDUSTRIA REIT	38.914	41,907	111	8,121	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	243.475	280,409	553	40,350	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	52.264	50,661	160	11,664	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	160.1	137.85	167	12,203	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	105.905	101,989	213	15,530	0.0	
SCENTRE GROUP	1,887.979	1,543,922	3,412	248,603	0.7	
CENTURIA OFFICE REIT	—	115,908	243	17,734	0.1	
WAYPOINT REIT LTD	156.535	208,852	576	41,998	0.1	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	9,586.567 24銘柄<7.0%>	8,802.655 25銘柄<6.6%>	31,301 —	2,280,661 —	— 6.6
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT	748.52	608.02	39,946	550,468	1.6	
PROSPERITY REIT	462	361	844	11,640	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	481	448	1,666	22,965	0.1	
CHAMPION REIT	691.07	602.07	2,528	34,845	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	384	313	1,223	16,864	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE (HK)	477	—	—	—	—	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	—	405	2,867	39,512	0.1	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	3,243.59 6銘柄<2.6%>	2,737.09 6銘柄<1.9%>	49,078 —	676,296 —	— 1.9
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND MALL TRUST	1,001.86	839.66	1,704	130,190	0.4	
ASCENDAS REAL ESTATE INV	911.76	881.66	2,750	210,104	0.6	

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	992.379	840.979	1,454	111,124	0.3	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	808.39	698.59	1,005	76,835	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	839.72	880.12	1,707	130,413	0.4	
STARHILL GLOBAL REIT	469.2	374.2	205	15,719	0.0	
ASCOTT TRUST	438.715	530.116	572	43,729	0.1	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	244.28	—	—	—	—	
KEPPEL REIT	626.4	553.6	614	46,935	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	230.1	208.3	510	38,979	0.1	
ESR REIT	660.33	636.53	257	19,690	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	257.6	250.9	281	21,463	0.1	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	233.38	232.58	304	23,271	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	198.5	180.1	129	9,904	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	217.695	140.595	175	13,423	0.0	
PARKWAY LIFE REIT	131.6	119.3	408	31,163	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	571.8	615	87	6,717	0.0	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	460.92	455.82	1,294	98,876	0.3	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	657.2	644.6	1,302	99,453	0.3	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	410.78	310.78	177	13,530	0.0	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	218.6	286.2	105	8,088	0.0	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	741.7	614.2	583	44,566	0.1	
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	283.5	—	—	—	—	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355.6	271.3	145	11,086	0.0	
SPH REIT	224.9	237	212	16,201	0.0	
OUE HOSPITALITY TRUST	445.32	—	—	—	—	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	256.4	275	110	8,401	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	—	165.2	125	9,589	0.0	
OUE COMMERCIAL REIT	—	773.055	309	23,618	0.1	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	—	203.6	149	11,429	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	273	235.7	117	9,001	0.0	
KEPPEL DC REIT	341	359.7	888	67,860	0.2	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	555.65	723.164	846	64,625	0.2	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	14,058.279 30銘柄<3.6%>	13,537.549 30銘柄<4.1%>	18,538 —	1,415,996 —	— 4.1
(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	380.191	326.171	544	37,268	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	127.868	106.603	273	18,745	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	361.871	328.996	697	47,721	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	512.744	447.199	482	33,045	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	282.83	247.066	286	19,608	0.1	
STRIDE STAPLED GROUP	140.039	—	—	—	—	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	1,805.543 6銘柄<0.5%>	1,456.035 5銘柄<0.4%>	2,285 —	156,388 —	— 0.4
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC	337.35	277.336	1,123	148,089	0.4	
CAPITAL & REGIONAL PLC	135.437	9.186	9	1,260	0.0	
DERWENT LONDON PLC	38.645	31.508	937	123,567	0.4	
BIG YELLOW GROUP PLC	54.616	48.36	492	64,939	0.2	
HAMMERSON PLC	269.495	233.838	244	32,232	0.1	
LAND SECURITIES GROUP PLC	265.466	221.691	1,343	176,981	0.5	
WORKSPACE GROUP PLC	46.404	38.577	269	35,534	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	295.875	231.04	11	1,522	0.0	
UNITE GROUP PLC	92.217	106.992	1,000	131,829	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	395.499	355.593	580	76,475	0.2	
SHAFESBURY PLC	80.557	63.788	363	47,956	0.1	
SEGRO PLC	379.728	327.645	2,884	380,130	1.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	95.824	73.391	477	62,864	0.2	
ASSURA PLC	854.448	788.073	641	84,535	0.2	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	204.861	187.713	61	8,088	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	194.275	170.446	116	15,386	0.0	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	159.52	—	—	—	—	

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			%	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD		227.534	254.022	167	22,093			0.1	
SAFESTORE HOLDINGS LTD		72.106	60.379	446	58,840			0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		251.418	269.096	600	79,150			0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT		—	245.021	178	23,538			0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL		—	247.221	423	55,774			0.2	
RDI REIT PLC		77.641	74.051	57	7,631			0.0	
NEWRIVER REIT PLC		103.999	102.138	69	9,112			0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		235.42	189.831	206	27,267			0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT		134.957	110.038	105	13,920			0.0	
TRITAX BIG BOX REIT PLC		598.461	512.115	747	98,530			0.3	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		196.113	186.961	103	13,698			0.0	
AEW UK REIT PLC		—	54.933	38	5,096			0.0	
LXI REIT PLC		134.197	159.926	182	24,025			0.1	
REGIONAL REIT LTD		110.888	129.74	97	12,822			0.0	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	6,042.951	5,760.649	13,984	1,842,897			—	
(イスラエル)		千口	千口	千イスラエル・シケル	千円			%	
REIT 1 LTD		63.655	52.551	722	22,334			0.1	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	63.655	52.551	722	22,334			—	
(韓国)		千口	千口	千韓国・ウォン	千円			%	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		9.316	10.894	72,989	6,423			0.0	
LOTTE REIT CO LTD		—	25.4	147,574	12,986			0.0	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	9.316	36.294	220,563	19,409			—	
(ユーロ…アイルランド)		千口	千口	千ユーロ	千円			%	
GREEN REIT PLC		240.878	—	—	—			—	
HIBERNIA REIT PLC		242.24	208.204	231	27,587			0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI		124.155	119.677	167	20,000			0.1	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	607.273	327.881	398	47,587			—	
(ユーロ…オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円			%	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		14.114	11.468	147	17,577			0.1	
VASTNED RETAIL		6.326	5.849	111	13,265			0.0	
WERELDHAVE NV		14.313	11.998	102	12,195			0.0	
NSI NV		6.338	5.133	184	21,966			0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		48.27	40.645	2,243	267,819			0.8	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	89.361	75.093	2,788	332,823			—	
(ユーロ…ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円			%	
BEFIMMO		7.94	6.929	282	33,663			0.1	
COFINIMMO SA		7.418	7.256	921	110,000			0.3	
RETAIL ESTATES		2.609	3.188	190	22,756			0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		8.307	6.779	153	18,288			0.1	
WAREHOUSES DE PAUW		6.236	38.064	933	111,434			0.3	
MONTEA SCA		3.562	3.259	285	34,078			0.1	
AEDIFICA		8.684	7.985	816	97,413			0.3	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	44.756	73.46	3,582	427,636			—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円			%	
GECINA SA		19.268	16.655	1,900	226,843			0.7	
ICADE		16.153	8.117	514	61,381			0.2	
ALTAREA		1.209	0.977	136	16,327			0.0	
KLEPIERRE		70.94	60.564	1,067	127,420			0.4	
COVIVIO		21.906	14.277	969	115,718			0.3	
MERCIALYS		18.406	7.165	54	6,551			0.0	
小計	口数・金 銘柄数<比率>	147.882	107.755	4,643	554,242			—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円			%	
HAMBORNER REIT AG		27.782	21.542	185	22,173			0.1	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期			末	
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	比 率	率
(ユーロ…ドイツ)	千口	千口	千ユーロ	千円			%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	56.116	46.459	638	76,254			0.2
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>
(ユーロ…スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円			%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	97.764	72.211	582	69,562			0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	25.183	18.634	88	10,565			0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	127.901	109.392	852	101,788			0.3
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>
(ユーロ…イタリア)	千口	千口	千ユーロ	千円			%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	15.915	14.335	49	5,852			0.0
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>
合 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>

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

(注2) < >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

2020年6月22日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	千円 34,662,937	% 98.9	千円 34,662,937	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	369,226	1.1	369,226	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	35,032,164	100.0	35,032,164	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、34,683,398千円、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6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.77円、1カナダ・ドル=78.37円、1オーストラリア・ドル=72.86円、1香港・ドル=13.78円、1シンガポール・ドル=76.38円、1ニュージーランド・ドル=68.42円、1イギリス・ポンド=131.78円、1イスラエル・シケル=30.91円、100韓国・ウォン=8.80円、1ユーロ=119.37円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	35,187,750,939円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	143,091,112
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	3,790,706,795
投 資 証 券(評価額)	30,872,230,731
未 収 入 金	300,884,664
未 収 配 当 金	80,837,637
(B) 負 債	434,323,086
未 払 金	430,282,086
未 払 解 約 金	4,041,000
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	34,753,427,853
元 本	31,818,365,833
次 期 繰 越 損 益 金	2,935,062,020
(D) 受 益 権 総 口 数	31,818,365,833口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C／D)	10,922円

(注1) 期首元本額 36,301,672,788円
追加設定元本額 63,049,855,284円
一部解約元本額 67,533,162,239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)	67,800,807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)	28,192,032円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	7,623,330円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	20,052,668円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	21,272,270円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	84,252,305円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	79,298,997円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	33,732,261円
たわらノーロード 先進国リート	6,472,824,918円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	800,466,510円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	300,736,279円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,032,535,921円
たわらノーロード バランス (堅実型)	9,582,980円
たわらノーロード バランス (標準型)	156,033,540円
たわらノーロード バランス (積極型)	301,916,594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)	71,016,875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)	255,469,351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)	174,107,265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)	291,954,248円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,282,274円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	6,404,870円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,259,508円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	10,979,388円
One DC先進国リートインデックスファンド	78,025,842円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,914,119円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	623,478,643円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	54,446,524円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	220,950,023円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	238,890,973円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	424,710,954円
投資のソムリエ	3,815,146,262円
投資のソムリエ<DC年金>	367,559,283円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	207,835,560円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	271,498,940円

リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,523,341,327円
ワールドアセットバランス (基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	557,429,997円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	3,573,174円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	2,102,378円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,607,966円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	7,214,900円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,095,722,412円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,612,190円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	953,333円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	404,989円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	433,365円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	664,483,683円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	96,261,935円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株先物活用型) 20-4	1,034,466,514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)	180,706,658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)	362,233,563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)	2,767,748,376円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	4,418,271,468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)	556,422,229円
期末元本合計	31,818,365,833円

■損益の状況

当期 自2019年6月25日 至2020年6月22日

項 目					当 期
(A)	配 当 受 取	等 配 取	収 当	益 金	1,547,074,960円
					1,545,817,211
			利 息		1,274,461
	の 他	収 益			334,638
	支 払	利 息			△351,350
(B)	有 価 証 券 売 買	損 益			△5,102,286,109
	売 買	益 損			3,734,044,964
					△8,836,331,073
(C)	そ の 他	費 用			△36,105,375
(D)	当 期 損 益	金(A + B + C)			△3,591,316,524
(E)	前 期 繰 越	損 益 金			11,108,533,203
(F)	解 約 差 損	益 金			△20,457,481,375
(G)	追 加 信 託 差 損	益 金			15,875,326,716
(H)	合 計(D + E + F + G)				2,935,062,020
	次 期 繰 越 損 益 金(H)				2,935,062,020

(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		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 額 総 額
		期 中 騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	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

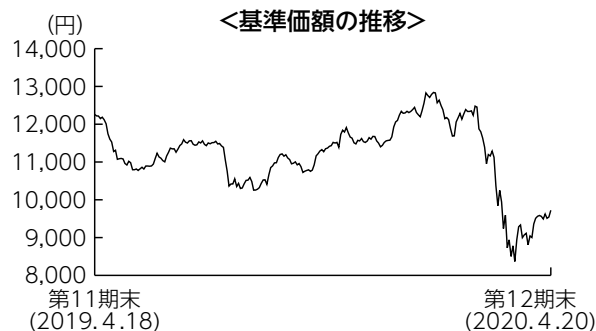
年 月 日	基 準 価 額		M S C I エ マー ジ ン グ ・ マ ー ケ ッ ト ・ イ ン デ ッ ク ス		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	(円換算ベース、 配 当 込 み、 為 替 ヘ ッ ジ な し) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2019年 4 月 18日	円 12,260	% －	ポ イ ン ト 276,323.22	% －	% 94.4	% 4.4	% 0.6
4 月 末	12,012	△2.0	270,962.63	△1.9	89.9	8.6	0.5
5 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）

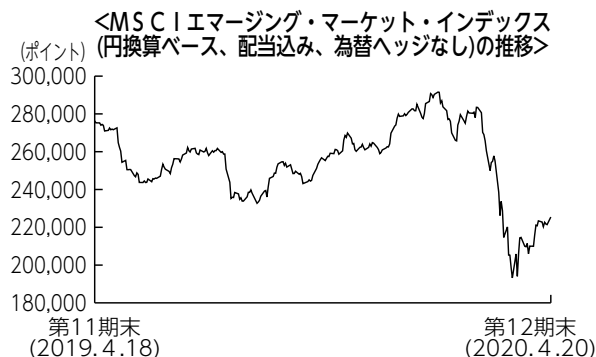


基準価額の推移

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	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		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	16,856.16 (146.86)	千アメリカ・ドル 51,386 (-)	27,934.82	千アメリカ・ドル 77,877
	香 港	554,549.5 (938)	千香港・ドル 581,838 (△305)	992,284.5	千香港・ドル 992,235
	台 湾	208,375.58 (1,865.75)	千台湾・ドル 1,126,428 (△1,378)	357,090	千台湾・ドル 2,042,558
	イ ギ リ ス	182.62 (-)	千イギリス・ポンド 189 (-)	312.4	千イギリス・ポンド 334
	ト ル コ	9,122.31 (209.16)	千トルコ・リラ 10,315 (-)	17,342.1	千トルコ・リラ 19,368
	メ キ シ コ	33,335.95 (△2,143)	千メキシコ・ペソ 114,920 (△12,997)	62,660.9	千メキシコ・ペソ 213,460
	フ ィ リ ピ ン	24,771.25 (191.22)	千フィリピン・ペソ 175,653 (-)	62,556.72	千フィリピン・ペソ 306,962
	チ リ	129,062.57 (8,941.39)	千チリ・ペソ 2,098,587 (-)	320,395.49	千チリ・ペソ 3,500,006
	コ ロ ン ビ ア	2,915.21 (-)	千コロンビア・ペソ 3,972,626 (-)	7,626.67	千コロンビア・ペソ 7,804,073
	カ タ ー ル	8,712.05 (18,556.38)	千カタル・リアル 11,648 (-)	18,546.81	千カタル・リアル 17,574

		買		付		売		付	
		株	数	金	額	株	数	金	額
外	サウジアラビア	16,494.48	百株 (77.55)	千サウジアラビア・リアル	59,534 (-)	8,312.54	百株	千サウジアラビア・リアル	28,127
	インド	50,337.27	百株 (1,309.58)	千インド・ルピー	2,322,225 (-)	76,161.37	百株	千インド・ルピー	3,635,329
	パキスタン	978.68	百株 (-)	千パキスタン・ルピー	12,229 (-)	2,122	百株	千パキスタン・ルピー	29,010
	インドネシア	204,703	百株 (23,972)	千インドネシア・ルピア	93,495,095 (-)	346,444.16	百株	千インドネシア・ルピア	165,267,725
	アラブ首長国連邦	9,635.31	百株 (-)	千アラブ首長国連邦・ディルハム	6,878 (-)	19,636.15	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	11,658
	ブラジル	37,577.79	百株 (827.9)	千ブラジル・レアル	102,312 (△4,702)	61,468.12	百株	千ブラジル・レアル	168,820
	チエコ	681.48	百株 (-)	千チエコ・コルナ	8,961 (-)	1,118.36	百株	千チエコ・コルナ	17,327
	韓国	9,608.49	百株 (21.69)	千韓国・ウォン	45,418,797 (△2,181)	16,134.78	百株	千韓国・ウォン	81,506,176
	中国	161,751.14	百株 (349.4)	千オフショア・人民元	178,257 (-)	121,032.2	百株	千オフショア・人民元	133,546
	マレーシア	45,839	百株 (-)	千マレーシア・リンギット	26,788 (-)	83,268.48	百株	千マレーシア・リンギット	46,889
	南アフリカ	26,475.81	百株 (△5,801.19)	千南アフリカ・ランド	252,464 (△46,237)	42,859.94	百株	千南アフリカ・ランド	436,794
	タイ	109,850	百株 (8,194.21)	千タイ・バーツ	363,305 (△75)	145,855.88	百株	千タイ・バーツ	467,777
	ポーランド	2,471.48	百株 (-)	千ポーランド・ズロチ	11,979 (-)	5,605.51	百株	千ポーランド・ズロチ	20,962
	ハンガリー	509.73	百株 (-)	千ハンガリー・フォリント	303,954 (-)	834.9	百株	千ハンガリー・フォリント	524,424
国	ユーロ	27	百株 (-)	千ユーロ	51 (-)	-	百株	千ユーロ	-
	ギリシャ	3,454.74	百株 (-)	千ユーロ	906 (-)	3,636.23	百株	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		売		付	
		証	券	数	金	証	券	数	金
外国	タイ	証券	-	千タイ・バーツ	-	証券	-	千タイ・バーツ	41
		(62,595)		(75)		112,163 (-)		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		売	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF	3,088.04 (-)	14,666 (-)	3,088.04 (-)	13,482 (-)
メキシコ	千□	千メキシコ・ペソ	千□	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□	千ブラジル・レアル	千□	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□	千南アフリカ・ランド	千□	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		業 種 等		
		株 数	株 数		期 末	
					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)		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 銘柄数<比率>	24,857.87 50銘柄	13,926.07 60銘柄	38,171 4,118,284	- <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 HUIZHAN 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 APPTTEC 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
HENGNTEN NETWORKS GROUP LTD		20,960	—	—	—	インターネット販売・通信販売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	892,466.75 207銘柄	455,669.75 207銘柄	459,608 —	6,397,743 <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	コンピュータ・周辺機器
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 銘柄 数<比率>	株数・金・額 銘柄 数<比率>	949,323	3,408,070	
(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 銘柄 数<比率>	株数・金・額 銘柄 数<比率>	148	20,040	
(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
ARCELİK	189.02	8.01	12	192	家庭用耐久財
AŞELSAN ELEKTRONİK SANAYİ	317.66	91.92	249	3,896	航空宇宙・防衛
EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI TAS	1,259.6	887.23	730	11,412	金属・鉱業
FORD OTOMOTİV SANAYİ 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
PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG	881.74	—	—	—	化学
TÜRK İSİ VE CAM FABRİKALARI 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 銘柄数<比率>	株数・金・額 銘柄数<比率>	7,304	114,164	
	14,542.25 18銘柄	6,531.62 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
ORBITA 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 銘柄数<比率>	株数・金・額 銘柄数<比率>	77,653	348,663	
	59,294.65 23銘柄	27,826.7 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	株 数	期 首(前期末)	株 数	当 期 末		業 種 等
				評 価	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(フィリピン)	百株	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	2,019	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	1,282	510	1,366	2,897	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	8,440	電力
GT CAPITAL HOLDINGS INC	91.37	24.11	1,181	2,504	2,504	コングロマリット
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	60,163.4	22,569.15	109,019	231,121	
		23銘柄	21銘柄	—	<0.6%>	
(チリ)	百株	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	64,144.7	27,996.58	91,828	11,597	11,597	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	47.7	33.79	96,301	12,162	12,162	銀行
BANCO DE CHILE	22,134.93	25,958.42	184,564	23,310	23,310	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,115.77	390.74	63,897	8,070	8,070	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	376.73	180.31	92,336	11,662	11,662	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	130.24	53.63	35,663	4,504	4,504	飲料
ENTEL CHILE SA	135.72	66.1	28,489	3,598	3,598	無線通信サービス
ENEL AMERICAS SA	28,187.18	19,544.64	266,784	33,694	33,694	電力
COLBUN SA	8,191.36	2,568.74	29,861	3,771	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	2,852	水道
EMBOTELLADORA ANDINA SA	404.01	200.26	37,849	4,780	4,780	飲料
LATAM AIRLINES GROUP SA	306.55	38.99	12,355	1,560	1,560	旅客航空輸送業
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	106.24	40.1	76,049	9,605	9,605	化学
FALABELLA SA	674.78	514.1	113,102	14,284	14,284	複合小売り
ITAU CORPBANCA	132,369.77	12,369.77	2,981	376	376	銀行
CENCOSUD SA	1,511.41	732.05	71,382	9,015	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	14,096	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	290,987.83	108,596.3	1,337,638	168,943	
		17銘柄	17銘柄	—	<0.4%>	
(コロンビア)	百株	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	10,690	電力
ECOPETROL SA	4,555.98	2,603.36	507,655	13,909	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	5,076	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	377.2	—	—	—	—	建設資材
GRUPO ARGOS SA	282.17	148.97	168,336	4,612	4,612	建設資材
BANCOLOMBIA SA	209.47	67.47	178,795	4,898	4,898	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	449.76	275.34	758,286	20,777	20,777	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	240.67	92.36	222,772	6,103	6,103	各種金融サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	10,076.44	5,364.98	2,411,284	66,069	
		9銘柄	7銘柄	—	<0.2%>	
(カタール)	百株	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	5,248	保険
QATAR NATIONAL BANK	429.98	2,186.04	3,869	114,260	114,260	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	182.02	758.09	304	8,990	8,990	銀行
OOREDOO QSC	67.6	534.59	327	9,659	9,659	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	—	292.53	492	14,555	14,555	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	50.5	326.18	482	14,255	14,255	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	—	286.75	230	6,810	6,810	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC	174.05	940.11	644	19,030	19,030	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	114.06	589.69	893	26,381	26,381	銀行
MASRAF AL RAYAN	365.35	1,604.22	601	17,755	17,755	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	167.63	1,000.55	276	8,163	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	9,646	化学
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,389.52	11,111.14	8,627	254,757	
		10銘柄	12銘柄	—	<0.6%>	
(サウジアラビア)	百株	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	15,445	化学
JARIR MARKETING CO	—	21.89	301	8,681	8,681	専門小売り

銘柄		期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(サウジアラビア)		百株	百株	千円	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	
銘柄数<比率>		—銘柄	33銘柄	—	<1.6%>	
(インド)		百株	百株	千円	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	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千円	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	コンプロマリット	
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)		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	
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 銘柄数<比率>	54,947.24 79銘柄	30,432.72 85銘柄	1,513,188 —	2,148,727 <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 銘柄数<比率>	1,679 3銘柄	535.68 3銘柄	6,051 —	3,933 <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 銘柄数<比率>	273,663.42 28銘柄	155,894.26 28銘柄	56,949,284 —	398,644 <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)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アラブ首長国連邦)		百株	百株	千円	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 銘柄数<比率>	19,061.42	9,060.58	4,655	136,979	
			7銘柄	—	<0.3%>	
(ブラジル)		百株	百株	千円	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)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 銘柄数<比率>	51,338.8 52銘柄	28,276.37 50銘柄	62,188 —	1,281,077 <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 銘柄数<比率>	773.1 3銘柄	336.22 3銘柄	7,346 —	31,588 <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
HELIUMITH 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 HOLDINGS 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	コンピュータリット
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 DOBCAT 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 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数	36,274,914	3,217,584	
		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
UNISPLENDOR 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
SHIJIAZHANG 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
INSUR 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	千円	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	千円	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 SINOCEA 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 APPTTEC 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	千円	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)		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	千円	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 PIENZHUANG 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	株数	金額	金額	
	22,976.2	64,044.54	82,257	1,253,600	
	銘柄数<比率>	73銘柄	259銘柄	—	<3.0%>
(マレーシア)	百株	百株	千円	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 銘 柄 数<比 率>	70,464.34 44銘柄	33,034.86 40銘柄	19,788 —	488,177 <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	株数	当 期 首(前期末)	株数	期 末		業 種 等
				評 価	額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	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 銘柄数<比率>	37,747.67 47銘柄	15,562.35 44銘柄	166,181 —	955,545 <2.3%>	
(タイ)	百株	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
KASIKORN BANK 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)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	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・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	324	239	2,820	9,363	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	2,276.1	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 銘 柄 数<比 率>	103,334.1 36銘柄	75,522.43 41銘柄	184,419 <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 銘 柄 数<比 率>	6,095.86 20銘柄	2,961.83 18銘柄	7,679 <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	医薬品 石油・ガス・消耗燃料 銀行	
RICHTER GEDEON NYRT		131.04	75.42	48,495	16,095		
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT		349.34	179.55	37,274	12,371		
OTP BANK NYRT		214.83	115.07	97,521	32,367		
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	695.21 3銘柄	370.04 3銘柄	183,291 —	60,834 <0.1%>		
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	建設資材	
TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA		—	27	30	3,596		
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	— 1銘柄	27 1銘柄	30 —	3,596 <0.0%>		
(ユーロ…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円		銀行 銀行 建設資材 各種電気通信サービス 繊維・アパレル・贅沢品 銀行 石油・ガス・消耗燃料 ホテル・レストラン・レジャー 専門小売り
ALPHA BANK A.E.		1,257.32	383.28	26	3,056		
NATIONAL BANK OF GREECE		—	263.48	30	3,615		
TITAN CEMENT CO. S.A.		40.89	—	—	—		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		220.51	145.18	170	19,953		
FF GROUP		31.3	31.3	0	0		
EUROBANK ERGASIAS SERVICES		—	748.45	27	3,212		
MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN		58.47	22.65	31	3,723		
OPAP SA		198.46	91.84	62	7,355		
JUMBO SA		115.02	54.3	75	8,838		
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,921.97 7銘柄	1,740.48 8銘柄	424 —	49,755 <0.1%>		
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	2,324,818.12 963銘柄	1,249,512.59 1,180銘柄	— —	26,646,081 <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) BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	証券 59,033 —	証券 — 9,465	千タイ・パーツ — 21	千円 — 70	
合 計	証 券 数 59,033 1銘柄	証 券 数 9,465 1銘柄	— —	70 <0.0%>	

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)	当期			期末
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(メキシコ)	千□	千□	千□	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	□ 数・金額 銘柄 数<比率>	1,995.875 3銘柄<0.5%>	1,121.575 6銘柄<0.3%>	26,935 —	120,940 —
(ブラジル)	千□	千□	千□	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	□ 数・金額 銘柄 数<比率>	— —銘柄<—%>	68.369 5銘柄<0.1%>	2,020 —	41,612 —
(南アフリカ)	千□	千□	千□	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	□ 数・金額 銘柄 数<比率>	108.558 3銘柄<0.1%>	403.149 3銘柄<0.1%>	3,739 —	21,500 —
合計	□ 数・金額 銘柄 数<比率>	2,104.433 6銘柄<0.6%>	1,593.093 14銘柄<0.4%>	— —	184,052 —

(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	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	
株 式	千円 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・リングgit＝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 ・ コ 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
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金> 5,997,328,714円
D I A M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
M I T O ラップ型ファンド (安定型) 2,677,342円
M I T O ラップ型ファンド (中立型) 8,945,691円
M I T O 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
One DC 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
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) 398,227,441円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) 400,152,689円
D I A M DC 8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
D I A M 8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
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) 7,287,401円
D I A M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
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 425,370,792円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) 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				息	32,304,661
そ	の	他	利	金	14,298,303
支			収	息	△235,843
	払		利	息	
(B) 有	価	証	券	売	△9,582,484,591
売			買	損	3,981,906,152
売			買	損	△13,564,390,743
(C) 先	物	取	引	等	△422,187,684
取			引	引	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 率 比	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
8 期 (2016年4月18日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	17,120	△6.9	81,716.02	△3.9	96.5	—	51,487
9 期 (2017年4月18日)		4.7	88,609.40	8.4	96.8	—	80,269
10期 (2018年4月18日)		△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	—	111,615
11期 (2019年4月18日)		7.8	93,647.60	6.8	97.5	—	108,066
12期 (2020年4月20日)		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

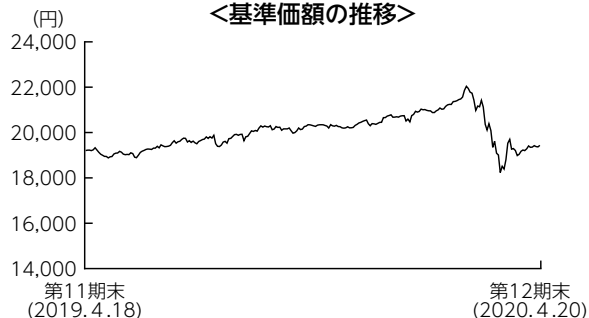
年 月 日	基 準 価 額		ＪＰモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019 年 4 月 18 日	円 19,206	% －	ポイント 93,647.60	% －	% 97.5	% －
4 月 末	19,229	0.1	92,912.02	△0.8	96.7	－
5 月 末	19,071	△0.7	92,204.77	△1.5	96.5	－
6 月 末	19,439	1.2	94,614.26	1.0	96.0	－
7 月 末	19,755	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＞



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

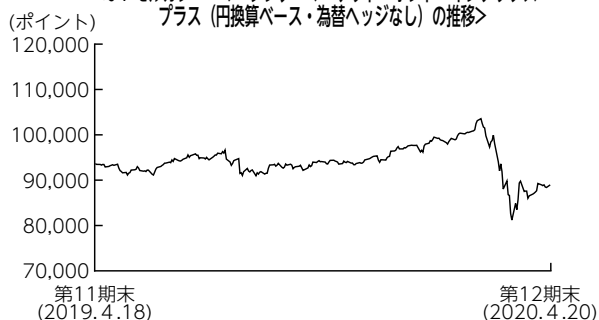
米国金利の低下や債券の利息収入を主因に、基準価額は上昇しました。

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。

＜JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の推移＞



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
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 1,892,513	千アメリカ・ドル 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年末満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 630,091	千アメリカ・ドル 698,504	千円 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			評 価 額			償還年月日
	種 類	利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
UNITED MEXICAN STATES 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	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日	
(アメリカ)					%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円								
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		未																						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月	日	
(アメリカ)					%	千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル		千円																			
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	
公 社 債	千円 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
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	196,333,833円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	203,727,538円
DIAM DC 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 損 益	10,342,537,916
売 買 損 益	△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。